

Jahresbericht und geprüfter Abschluss

Franklin Templeton
Global Funds Plc

Ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025

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

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilsinhaber	16
Bericht des Verwaltungsrats	17
Bericht der Verwahrstelle	20
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	21
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	24
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	26
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	34
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	42
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	46
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	50
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	54
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	56
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	59
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Credit Fund^	63
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	67
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	76
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	80
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund^	88
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	92
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	94
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	96
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	98
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	100
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	104
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	106
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	107
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Value Fund	108
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	110
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	111
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	112
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	114
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	116
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	118
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	120
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	122
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	123
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	124
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	127
Anlagenportfolio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	129
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^	130
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^	131
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^	132
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	133
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	134
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	136
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	137
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2028 Fund^	138
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2029 Fund^	139
Bilanz – Franklin Templeton Global Funds Plc	140
Gesamtergebnisrechnung – Franklin Templeton Global Funds Plc	158
Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – Franklin Templeton Global Funds Plc	168
Erläuterungen zum Abschluss – Franklin Templeton Global Funds Plc	195

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	258
Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	263
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	274
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	274
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	274
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US High Yield Fund	275
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	276
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	276
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	277
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	278
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	278
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	278
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	279
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	279
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	279
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	280
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	280
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	280
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	281
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	281
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	282
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	282
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	282
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Value Fund	283
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	283
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	284
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	284
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	285
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	285
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	286
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	286
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	287
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	287
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	288
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	288
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	288
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	289
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	289
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	290
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	290
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	290
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	291
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	291
Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)	292
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)	293
Anhang: Offenlegung von Geschäften mit verbundenen Personen (ungeprüft)	294
Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)	295

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Elinor Murray (Großbritannien)
 Jaspal Saggar (Großbritannien)
 Craig Tyle (USA)

Geschäftssitz

Bis zum 9. Juni 2025:
 Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Ab dem 9. Juni 2025:
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 Irland

Secretary

OGS Corporate Governance Limited
 30 Molesworth Street
 Dublin 2, D02 AY19
 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., Taipei
 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

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilsinhaber)

Britische Anteilsinhaber 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
 Feldeggstrasse 12
 CH-8008 Zürich
 Schweiz

Schweizer Zahlstelle

NPB Neue Privat Bank AG
 Limmatquai 1
 CH-8001 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
Bis zum 9. Juni 2025:
 Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Ab dem 9. Juni 2025:
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 Irland

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
Bis zum 9. Juni 2025:
 One Dockland Central
 Guild Street, IFSC
 Dublin 1, D01 E4X0
 Irland

Ab dem 9. Juni 2025:
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 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	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 US Core Bond Fund*	30. August 2002	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 US Core Plus Bond Fund*	20. April 2007	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
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund ^{a*}	1. Oktober 2003 (Handel eingestellt am 29. Juli 2024)	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 Short Duration High Income Bond Fund ^{a*b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 16. Februar 2023)	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 Global Multi Strategy Fund*	29. August 2002	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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	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 Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{^*b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 10. Oktober 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 Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{^**}	21. Oktober 2011 (Handel eingestellt am 21. Juni 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 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 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien
FTGF Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	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
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^{^*b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 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

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 ^{^**}	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 ^{^*p}	5. September 2013 (Handel eingestellt am 29. Oktober 2024)	<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
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>
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 ^{^*†}	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 ^{^*†}	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>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
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>
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>

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^{^*b}	10. Januar 2022 (Handel eingestellt am 5. Dezember 2023)	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 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien
FTGF Western Asset China Bond Fund^{^*^}		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 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^{^*z}	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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
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
FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund^{*^b} (vormals Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund)	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^{*^b}	16. August 2018 (Handel eingestellt am 17. Juli 2024)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^{*^b}	1. Dezember 2022 (Handel eingestellt am 19. Dezember 2024)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^{*^a}	6. November 2023	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
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^{*^a}		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund^{^a}	24. März 2025	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF ClearBridge US Value Fund^{**} (vormals 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^{**} (mit Wirkung vom 28. April 2025 umbenannt in FTGF Putnam US Research Fund)	20. April 2007	Anlageverwalter: <i>Bis zum 28. April 2025:</i> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA <i>Ab dem 28. April 2025:</i> The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
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 Leaders Fund ^{***^} (vormals 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 ^{***^} (mit Wirkung vom 28. April 2025 umbenannt in FTGF ClearBridge Global Value 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 ^{***^z}	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
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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
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^{**^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^{**^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
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^{**^z}	11. März 2016 (hat den Handel am 1. Juni 2021 eingestellt)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^{**^b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^{**^b}	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} (wird am 14. Juli 2025 in FTGF Franklin European Unconstrained Fund umbenannt)	28. Juni 2016	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd (bis 14. Juli 2025) Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Franklin Templeton Investment Management Limited (ab 14. Juli 2025) Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^{**^b}	28. Juni 2016 (Handel eingestellt am 26. Juli 2024)	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^{**+^a}		Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund***^ (wird am 14. Juli 2025 in FTGF Franklin European Unconstrained Fund umbenannt)	9. November 2018	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd (bis 14. Juli 2025) Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Franklin Templeton Investment Management Limited (ab 14. Juli 2025) Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Martin Currie Improving Society Fund***^	20. Juni 2023 (Handel wird am 7. Juli 2025 eingestellt)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund***^		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^b	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, Handel wieder aufgenommen am 13. April 2012 und Handel eingestellt am 30. August 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund^b	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund**^	23. Januar 2023	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
Franklin Responsible Income 2029 Fund**^	27. März 2024	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Franklin Responsible Income Series 3 Fund**^		Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund**^	4. April 2025	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund**^	4. April 2025	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund***^	4. April 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund***^	14. März 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Putnam Balanced Fund***^	27. Mai 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam Global Healthcare Fund ***^	30. Mai 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA

† 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).
p Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.
d Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 12. November 2024 von der Zentralbank widerrufen.
π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 8. Mai 2025 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)	Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika
Franklin Templeton International Services S.à r.l 8A, rue Albert Borschette L-1246 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg www.franklinresources.com	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 28. Februar 2025 vorlegen zu können. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

Mit freundlichen Grüßen

Bericht über die Weltwirtschaft

Trotz zahlreicher negativer Einflussfaktoren zeigte sich die Weltwirtschaft robust und setzte ihr Wachstum im Berichtszeitraum fort. In seinem *World Economic Outlook Update* von Januar 2025 prognostizierte der Internationale Währungsfonds („IWF“) ein Wachstum des globalen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) von 3,3 % im Jahr 2025 (2024: 3,2 %). Laut IWF „ist die Prognose für 2025 weitgehend unverändert gegenüber dem Weltwirtschaftsausblick vom Oktober 2024, was in erster Linie auf eine Aufwärtskorrektur in den Vereinigten Staaten zurückzuführen ist, die die Abwärtskorrekturen in anderen großen Volkswirtschaften ausgleicht. Es wird erwartet, dass die globale Gesamtinflation im Jahr 2025 auf 4,2 % und im Jahr 2026 auf 3,5 % zurückgeht, wobei die Annäherung an den Zielwert in den Industrieländern früher eintreten dürfte als in den Schwellen- und Entwicklungsländern. Die mittelfristigen Risiken für das Basisszenario sind eher abwärts gerichtet, während die kurzfristigen Aussichten durch divergierende Risiken gekennzeichnet sind.“ Aus regionaler Perspektive prognostiziert der IWF, dass das BIP-Wachstum im Jahr 2025 in den USA bei 2,7 % (2024: 2,8 %), in der Eurozone bei 1,0 % (2024: 0,8 %), im Vereinigten Königreich bei 1,6 % (2024: 0,9 %) und in Japan bei 1,1 % (2024: -0,2 %) liegen wird.

Marktüberblick – Rentenmärkteⁱ

Der globale Rentenmarkt erfuhr Phasen der Volatilität, erzielte im Berichtszeitraum jedoch eine positive Rendite. Im Juli 2023 erhöhte die US-Notenbank („Fed“) den Leitzins angesichts der hohen Inflation auf 5,25–5,50 %, den höchsten Stand seit 22 Jahren. Danach legte die Zentralbank bis September 2024 eine Zinspause ein und senkte dann die Zinssätze zum ersten Mal seit März 2020. Die Zentralbank senkte die Zinssätze auf ihren Sitzungen im November und Dezember 2024 erneut, belässt sie seitdem jedoch unverändert, da die Inflation über dem Zielwert von 2 % liegt. Auf ihrer Sitzung im Januar 2025 waren sich die Fed-Vertreter einig, dass sie einen weiteren Rückgang der Inflation abwarten müssen, bevor sie die Zinssätze erneut senken können, und äußerten sich besorgt über die Auswirkungen der Zollpläne von Präsident Trump. Insgesamt erzielten globale Anleihen, gemessen am Bloomberg Global Aggregate Bond Index, in den 12 Monaten zum 28. Februar 2025 eine Rendite von 2,98 %. US-Unternehmensanleihenⁱⁱ mit niedrigerem Rating und auf US-Dollar lautende Schwellenländer-Staatsanleihen erzielten im Berichtszeitraum noch bessere Ergebnisse.

Marktüberblick – Globale Aktienⁱⁱⁱ

Der globale Aktienmarkt verzeichnete im Berichtszeitraum starke Ergebnisse. Der Markt wurde durch das globale Wachstum, die nachlassende Inflation und die starke Entwicklung von Unternehmen mit Bezug zu künstlicher Intelligenz (KI) unterstützt. Im Berichtsjahr zum 28. Februar 2025 rentierte der S&P 500 Index mit 18,41 %. Außerhalb der USA verzeichneten internationale Industrieländeraktien, gemessen am MSCI EAFE Index (net), einen Zuwachs von 8,77 %, während Schwellenländeraktien, gemessen am Emerging Markets Index (net), mit 10,07 % rentierten.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Franklin Templeton International Services S.à r.l

März 2025

Die Wertentwicklung der Vergangenheit ist keine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung. Die Informationen stellen keine Prognose künftiger Ereignisse, keine Garantie für künftige Ergebnisse und keine Anlageempfehlungen dar.

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 28. Februar 2025, sofern nichts anderes angegeben ist.

Franklin Templeton Global Funds plc ist ein Umbrella-Fonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds, gegründet als offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital und zugelassen von der irischen Zentralbank als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren.

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

Die Informationen in diesem Dokument 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. Es handelt sich auch nicht um eine vollständige Zusammenfassung oder Darstellung aller verfügbaren Daten.

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 bei BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company, One Dockland Central, Guild Street, IFSC, Dublin 1, Irland sowie unter 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 Unternehmensanleihe – eine Anleihe, die von einem Unternehmen begeben wird, um zur Expansion seines Geschäfts effektiv Geld zu beschaffen.

ⁱⁱⁱ 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 28. Februar 2025 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 aufzuzeichnen und zu erläutern,
- es jederzeit zu ermöglichen, die Aktiva und Passiva, die finanzielle Position sowie den Gewinn oder Verlust der Gesellschaft mit angemessener Genauigkeit zu ermitteln, und
- es dem Verwaltungsrat zu erlauben sicherzustellen, dass der Abschluss die Anforderungen des Companies Act von 2014 erfüllt, und eine Prüfung dieses Abschlusses zu 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 Anteilshaber 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 ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden in den Anlagenportfolios der Fonds ausgewiesen.

Zum 28. Februar 2025 hat das Unternehmen 40 aktive Fonds (2024: 44 Fonds). Einzelheiten zu ihren Nettoinventarwerten zum 28. Februar 2025 sind der Bilanz auf den Seiten 140 bis 157 zu entnehmen.

Mit Wirkung vom 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^] in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^] umbenannt.

Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel ein.

Risikomanagement – Ziele und Richtlinien

Informationen zu den Zielen und Grundsätzen des Risikomanagements der Gesellschaft sind in Erläuterung 12 zum Abschluss enthalten.

Ergebnisse des Berichtsjahres und Finanzlage zum Ende des Berichtsjahres

Die Bilanz zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 und die Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 sind auf den Seiten 140 bis 157 bzw. 158 bis 166 dargelegt.

Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Die Ausschüttungen an die Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen für die am 28. Februar 2025 und am 29. Februar 2024 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)
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Elinor Murray (Großbritannien)
 Jaspal Saggar (Großbritannien)
 Craig Tyle (USA)

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs

Der Verwaltungsrat bzw. der Gesellschaftssekretär und deren Familien besitzen keine Beteiligungen an den Anteilen der Gesellschaft zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024. 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 Anteilseigner 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 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 – US Fixed Income 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[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 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“)).

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

Transparenz bei der Bewertung 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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

(„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 Übergangsaktivitäten 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 Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF ClearBridge US 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 Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers 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[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 Fund[^].

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

19. Juni 2025

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht der Verwahrstelle

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilsinhaber 19. Juni 2025

Für den Berichtszeitraum vom 1. März 2024 bis 28. Februar 2025 (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 Anteilsinhaber 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,
20-26 Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2, D02 Y049
Irland

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
- 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) ordnungsgemäß erstellt wurde.

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

- die Bilanz zum 28. Februar 2025,
- 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 der Teilfonds zum 28. Februar 2025 und
- den Anhang zum Jahresabschluss für die Gesellschaft und jeden ihrer Teilfonds nebst 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.

Hervorhebung eines Sachverhalts – Jahresabschluss, der auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde

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 Euro Core Plus Bond Fund[^], 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 Western Asset Macro Opportunities 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[^], FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth 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[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Mit Ausnahme des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], 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 Western Asset Macro Opportunities 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[^], FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth 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[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society 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 Euro Core Plus Bond Fund[^], 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 Western Asset Macro Opportunities 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[^], FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth 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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers – (Fortsetzung)

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung – (Fortsetzung)

Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society 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.

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 28. Februar 2025 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 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 der Stellungnahmen, wurde für und nur 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.

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers – *(Fortsetzung)*

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

19. Juni 2025

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

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 – 75,43 % (29. Februar 2024: 73,28 %)					
USA – 75,43 % (29. Februar 2024: 73,28 %)					
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,485 %, fällig 07.03.2025 *	15.000	0,89	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,365 %, fällig 27.06.2025 *	10.000	0,60
2.250 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,400 %, fällig 09.04.2025 *	2.250	0,13	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 4,360 %, fällig 03.07.2025 *	20.000	1,19
6.750 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,390 %, fällig 23.04.2025 *	6.750	0,40	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 4,370 %, fällig 10.07.2025 *	20.000	1,19
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,375 %, fällig 24.04.2025 *	10.000	0,59	3.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,475 %, fällig 10.07.2025 *	3.000	0,18
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,480 %, fällig 01.05.2025 *	15.002	0,89	20.000 Federal Home Loan Banks, 4,385 %, fällig 18.07.2025 *	20.000	1,19
30.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,515 %, fällig 02.05.2025 *	30.007	1,79	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,360 %, fällig 14.08.2025 *	10.000	0,60
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 4,365 %, fällig 27.05.2025 *	20.000	1,19	20.000 Federal Home Loan Banks, 4,420 %, fällig 19.08.2025 *	20.000	1,19
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,400 %, fällig 06.06.2025 *	10.000	0,59	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,375 %, fällig 29.08.2025 *	20.000	1,19
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,510 %, fällig 11.07.2025 *	20.007	1,19	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,365 %, fällig 12.09.2025 *	10.000	0,60
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 4,420 %, fällig 26.08.2025 *	20.000	1,19	12.780 Federal Home Loan Banks, 3,875 %, fällig 19.09.2025	12.749	0,76
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 4,425 %, fällig 05.09.2025 *	15.000	0,89	10.000 Federal Home Loan Banks, 4,500 %, fällig 12.12.2025	10.018	0,60
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 4,360 %, fällig 08.09.2025 *	20.000	1,19	5.000 Federal Home Loan Banks, 4,500 %, fällig 13.03.2026	5.010	0,30
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,515 %, fällig 15.09.2025 *	15.007	0,89	8.165 Federal Home Loan Mortgage Corp, 0,375 %, fällig 23.09.2025	7.990	0,48
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 4,660 %, fällig 03.10.2025 *	20.027	1,19	10.907 Federal National Mortgage Association, 0,600 %, fällig 28.08.2025	10.715	0,64
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 4,380 %, fällig 09.10.2025 *	10.000	0,59	32.780 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.03.2025	32.776	1,95
5.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,125 %, fällig 03.02.2026	4.994	0,30	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 13.03.2025	19.976	1,19
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.08.2025	4.899	0,29	25.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.03.2025	24.954	1,49
5.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 02.09.2025	4.894	0,29	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 20.03.2025	19.960	1,19
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.03.2025	14.996	0,89	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 25.03.2025	19.948	1,19
30.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.03.2025	29.985	1,78	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 01.04.2025	19.932	1,19
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.03.2025	14.984	0,89	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 08.04.2025	19.914	1,19
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 19.03.2025	14.972	0,89	15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.04.2025	14.933	0,89
20.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.04.2025	19.931	1,19	20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.04.2025	19.894	1,18
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.04.2025	14.921	0,89	15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.05.2025	14.869	0,88
20.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.05.2025	19.844	1,18	15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.05.2025	14.843	0,88
18.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 14.05.2025	17.844	1,06	15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.06.2025	14.831	0,88
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.05.2025	14.871	0,88	10.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 01.07.2025	9.861	0,59
15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.06.2025	14.822	0,88	15.850 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.07.2025	15.588	0,93
16.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 23.09.2025	15.621	0,93	10.000 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.05.2025	9.960	0,59
35.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,365 %, fällig 11.03.2025 *	35.000	2,08	10.000 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.06.2025	9.990	0,59
6.105 Federal Home Loan Banks, 4,400 %, fällig 14.03.2025 *	6.105	0,36	10.000 United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 30.09.2025	10.037	0,60
31.500 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 4,385 %, fällig 18.03.2025 *	31.500	1,87	10.000 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.12.2025	9.689	0,58
20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0003, 4,380 %, fällig 01.04.2025 *	20.000	1,19	15.000 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 31.12.2025	14.999	0,89
25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,380 %, fällig 10.04.2025 *	25.000	1,49	10.000 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.02.2026	9.754	0,58
20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,500 %, fällig 21.04.2025 *	20.003	1,19		1.267.807	75,43
20.000 Federal Home Loan Banks, 4,385 %, fällig 07.05.2025 *	20.000	1,19	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.267.807 \$)		
6.400 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,500 %, fällig 19.05.2025 *	6.402	0,38	Umgekehrte Pensionsgeschäfte – 26,03 % (29. Februar 2024: 27,78 %)		
20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0004, 4,360 %, fällig 22.05.2025 *	20.000	1,19	USA – 26,03 % (29. Februar 2024: 27,78 %)		
20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0008, 4,355 %, fällig 28.05.2025 *	20.000	1,19	140.000 Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 140.050.750 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 142.851.803 USD), 4,350 %, fällig 03.03.2025	140.000	8,33
25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,390 %, fällig 09.06.2025 *	25.000	1,49	75.000 HSBC Bank USA, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 75.026.938 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 76.527.482 USD), 4,310 %, fällig 03.03.2025	75.000	4,46
20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0003, 4,360 %, fällig 10.06.2025 *	20.000	1,19	150.000 JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 150.054.500 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 153.055.614 USD), 4,360 %, fällig 03.03.2025	150.000	8,92
30.000 Federal Home Loan Banks, Series 0005, 4,360 %, fällig 16.06.2025 *	30.000	1,78	50.000 Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 50.017.917 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 51.000.066 USD), 4,300 %, fällig 03.03.2025	50.000	2,98
9.600 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,475 %, fällig 16.06.2025 *	9.602	0,57	22.443 TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 22.451.173 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 22.891.889 USD), 4,370 %, fällig 03.03.2025	22.443	1,34
6.375 Federal Home Loan Banks, 4,500 %, fällig 17.06.2025 *	6.376	0,38		437.443	26,03
30.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,400 %, fällig 18.06.2025 *	30.001	1,79	Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte (Anschaffungskosten 437.443 \$)		
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
			Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
			Gesamtnettovermögen		
			1.705.250		
			1.705.250		
			-24.494		
			1.680.756 \$		
			101,46		
			101,46		
			-1,46		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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 %.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	74,12
Geldmarktinstrumente	25,57
Sonstige Vermögenswerte	0,31
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 10,65 % (29. Februar 2024: 8,75 %)							
600	AB BSL CLO 4 Ltd, Series 2023 4A, Class A, 144A, 6,293 %, fällig 22.04.2036 *	602	0,62	210	BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	204	0,21
200	Apidos CLO XXXVII, Series 2021 37A, Class A, 144A, 5,682 %, fällig 22.10.2034 *	200	0,21	130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	126	0,13
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, Series 2003 W3, Class M1, 4,213 %, fällig 25.09.2033 *	383	0,39	9.752	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5, Class XA, 0,454 %, fällig 15.07.2051 *	124	0,13
149	Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Class A1AR, 144A, 5,655 %, fällig 20.01.2031 *	149	0,15	879	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 5,859 %, fällig 15.07.2035 *	878	0,90
140	Birch Grove CLO 6 Ltd, Series 2023 6A, Class A1, 144A, 6,493 %, fällig 20.07.2035 *	141	0,14	351	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class A1, 144A, 6,285 %, fällig 25.02.2064	355	0,36
450	Birch Grove CLO 8 Ltd, Series 2024 8A, Class A1, 144A, 5,923 %, fällig 20.04.2037 *	453	0,46	235	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A1, 144A, 5,803 %, fällig 25.06.2064	237	0,24
340	Black Diamond CLO 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class A1, 144A, 6,279 %, fällig 25.10.2037 *	342	0,35	100	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Class A4, 3,631 %, fällig 10.02.2050	95	0,10
414	Brazos Higher Education Authority Inc, Series 2011 2, Class A3, 5,818 %, fällig 27.10.2036 *	414	0,42	3.399	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,913 %, fällig 15.11.2049 *	38	0,04
210	Brightwood Capital MM CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class A1A, 144A, 7,052 %, fällig 15.10.2035 *	212	0,22	183	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, Series 2017 C4, Class A3, 3,209 %, fällig 12.10.2050	177	0,18
260	CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class A1, 144A, 5,961 %, fällig 20.10.2037 *	262	0,27	144	COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	144	0,15
270	Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 5,684 %, fällig 17.07.2034 *	271	0,28	340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 7,452 %, fällig 25.03.2042 *	354	0,36
51	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2001 HE22, Class A1, 4,914 %, fällig 25.02.2032 *	50	0,05	430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Series 2023 R06, Class 1M2, 144A, 7,052 %, fällig 25.07.2043 *	446	0,46
27	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Series 2007 13, Class 2A2, 5,234 %, fällig 25.10.2047 *	25	0,03	250	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 6,152 %, fällig 25.01.2044 *	253	0,26
117	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Series 2004 5, Class 2A, 4,934 %, fällig 25.10.2034 *	112	0,11	378	Cross 2024-H2 Mortgage Trust, Series 2024 H2, Class A1, 144A, 6,093 %, fällig 25.04.2069	381	0,39
20	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Class 2A1A, 4,566 %, fällig 15.07.2036 *	19	0,02	100	CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class A5, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	99	0,10
420	Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, Series 2021 57A, Class A1, 144A, 6,052 %, fällig 25.10.2034 *	421	0,43	902	CSMC 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B2, 144A, 3,578 %, fällig 25.02.2048 *	825	0,84
150	Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Series 2023 66A, Class A, 144A, 6,250 %, fällig 25.04.2036 *	151	0,15	1	Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	–	–
390	Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class A1, 144A, 6,112 %, fällig 25.10.2037 *	392	0,40	3	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	1	–
345	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Series 2023 3C, Class A, 144A, 6,500 %, fällig 20.07.2055	345	0,35	7	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	1	–
470	Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A2I, 144A, 3,445 %, fällig 26.02.2052	452	0,46	7	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	1	–
278	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	229	0,23	2	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	–	–
435	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 5,184 %, fällig 25.02.2034 *	429	0,44	464	Fannie Mae Interest Strip 440, Class C50, 4,500 %, fällig 25.10.2053	105	0,11
173	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Series 2004 4, Class M1, 5,334 %, fällig 25.10.2034 *	166	0,17	1.500	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	1.307	1,33
345	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Series 2004 NC8, Class M1, 5,349 %, fällig 25.09.2034 *	339	0,35	300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	295	0,30
310	Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	239	0,24	300	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	300	0,31
160	Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class AR2, 144A, 5,602 %, fällig 15.10.2034 *	160	0,16	27	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01.10.2044	27	0,03
270	Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class A1R, 144A, 5,623 %, fällig 20.07.2035 *	271	0,28	16	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig 01.06.2043	16	0,02
460	OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class A1, 144A, 5,793 %, fällig 20.04.2037 *	463	0,47	171	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig 01.02.2041	165	0,17
340	Owl Rock CLO III Ltd, Series 2020 3A, Class AR, 144A, 6,143 %, fällig 20.04.2036 *	343	0,35	7	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01.05.2040	7	0,01
49	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class A4A, 4,860 %, fällig 16.12.2041 *	49	0,05	58	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 01.10.2046	51	0,05
253	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 9,176 %, fällig 15.10.2041 *	266	0,27	42	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01.11.2046	39	0,04
96	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	93	0,09	32	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 01.12.2046	28	0,03
179	SMB Private Education Loan Trust 2024-A, Series 2024 A, Class A1A, 144A, 5,240 %, fällig 15.03.2056	182	0,19	20	Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 01.04.2025	20	0,02
252	SMB Private Education Loan Trust 2024-E, Series 2024 E, Class A1A, 144A, 5,090 %, fällig 16.10.2056	255	0,26	41	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig 01.06.2042	40	0,04
240	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class AA, 144A, 2,301 %, fällig 28.02.2033	230	0,24	18	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01.09.2042	17	0,02
160	Trestles CLO VII Ltd, Series 2024 7A, Class A1, 144A, 6,203 %, fällig 25.10.2037 *	161	0,16	16	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 01.06.2043	14	0,01
490	Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1, 144A, 5,735 %, fällig 20.07.2034 *	491	0,50	35	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	32	0,03
460	Trinitas CLO XXV Ltd, Series 2023 25A, Class A1, 144A, 6,140 %, fällig 23.01.2037 *	464	0,48	190	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, fällig 01.06.2046	176	0,18
203	Voya CLO 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class A1R2, 144A, 5,502 %, fällig 15.10.2031 *	203	0,21	82	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 01.08.2046	73	0,07
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 10.411 \$)		10.429	10,65	51	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 01.09.2046	45	0,05
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 46,90 % (29. Februar 2024: 42,48 %)							
507	AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 6,554 %, fällig 17.06.2039 *	507	0,52	17	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 01.02.2037	17	0,02
				34	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 01.02.2047	30	0,03
				38	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig 01.05.2047	36	0,04
				14	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig 01.06.2043	14	0,01
				22	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	20	0,02
				37	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 01.05.2046	33	0,03
				57	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 01.08.2046	51	0,05
				79	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 01.09.2046	71	0,07
				31	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01.01.2047	28	0,03
				34	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 01.10.2046	30	0,03
				167	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 01.02.2056	159	0,16
				38	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 01.11.2046	38	0,04
				75	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	71	0,07
				159	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01.06.2057	149	0,15
				31	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01.08.2058	30	0,03
				171	Fannie Mae Pool 'BF0646', 2,500 %, fällig 01.06.2062	141	0,14
				13	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, fällig 01.05.2048	13	0,01
				362	Fannie Mae Pool 'BM4579', 3,000 %, fällig 01.04.2047	321	0,33
				30	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01.03.2043	29	0,03
				483	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 01.12.2048	474	0,48
				70	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 01.11.2050	60	0,06
				67	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 01.02.2051	54	0,05
				64	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 01.02.2051	52	0,05
				–	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 01.02.2051	–	–
				60	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	49	0,05

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
62 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	0,05	20 Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, fällig 01.05.2050	19	0,02
69 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 01.03.2051	56	0,06	52 Fannie Mae Pool 'MA4177', 2,500 %, fällig 01.11.2040	46	0,05
– Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 01.03.2051	–	–	1.030 Fannie Mae Pool 'MA4422', 2,000 %, fällig 01.09.2041	888	0,91
73 Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 01.03.2051	59	0,06	– Fannie Mae Pool 'MA4446', 2,000 %, fällig 01.10.2041	–	–
– Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 01.03.2051	–	–	313 Fannie Mae Pool 'MA4473', 1,500 %, fällig 01.11.2041	262	0,27
– Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 01.03.2051	–	–	161 Fannie Mae Pool 'MA4643', 3,000 %, fällig 01.05.2042	145	0,15
– Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 01.03.2051	–	–	6 Fannie Mae REMICS, Series 2001 81, Class GE, 6,000 %, fällig 25.01.2032	6	0,01
70 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 01.07.2051	60	0,06	15 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Class ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	15	0,02
118 Fannie Mae Pool 'BT1311', 2,000 %, fällig 01.07.2051	96	0,10	1 Fannie Mae REMICS, Series 2011 87, Class SG, 2,084 %, fällig 25.04.2040 *	–	–
70 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 01.08.2051	60	0,06	1 Fannie Mae REMICS, Series 2012 101, Class AI, 3,000 %, fällig 25.06.2027	–	–
80 Fannie Mae Pool 'BU1421', 3,000 %, fällig 01.01.2052	70	0,07	115 Fannie Mae REMICS, Series 2012 118, Class VZ, 3,000 %, fällig 25.11.2042	104	0,11
– Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	–	–	60 Fannie Mae REMICS, Series 2012 134, Class SK, 1,684 %, fällig 25.12.2042 *	7	0,01
– Fannie Mae Pool 'BV3089', 2,500 %, fällig 01.02.2052	–	–	4 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	4	–
225 Fannie Mae Pool 'BV4195', 3,000 %, fällig 01.03.2052	198	0,20	6 Fannie Mae REMICS, Series 2012 75, Class NS, 2,134 %, fällig 25.07.2042 *	1	–
80 Fannie Mae Pool 'BW9916', 5,000 %, fällig 01.10.2052	79	0,08	317 Fannie Mae REMICS, Series 2012 96, Class SB, 1,584 %, fällig 25.09.2042 *	26	0,03
80 Fannie Mae Pool 'BX0553', 5,500 %, fällig 01.10.2052	80	0,08	7 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	7	0,01
759 Fannie Mae Pool 'BX8180', 5,500 %, fällig 01.04.2053	764	0,78	8 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	9	0,01
165 Fannie Mae Pool 'BX9419', 5,000 %, fällig 01.03.2053	163	0,17	110 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	66	0,07
257 Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, fällig 01.05.2048	245	0,25	71 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	12	0,01
456 Fannie Mae Pool 'CA7240', 2,500 %, fällig 01.10.2050	388	0,40	129 Fannie Mae REMICS, Series 2020 57, Class TA, 2,000 %, fällig 25.04.2050	112	0,11
– Fannie Mae Pool 'CA7422', 2,000 %, fällig 01.10.2040	–	–	69 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	11	0,01
66 Fannie Mae Pool 'CA7531', 3,000 %, fällig 01.10.2050	59	0,06	475 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	76	0,08
144 Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, fällig 01.05.2041	127	0,13	406 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97, Class AI, 2,000 %, fällig 25.01.2051	57	0,06
492 Fannie Mae Pool 'CB1538', 2,500 %, fällig 01.09.2051	407	0,42	711 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class QI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	114	0,12
– Fannie Mae Pool 'CB2775', 2,500 %, fällig 01.02.2052	–	–	65 Fannie Mae REMICS, Series 2021 65, Class JA, 2,000 %, fällig 25.01.2046	58	0,06
162 Fannie Mae Pool 'CB3234', 3,000 %, fällig 01.04.2052	142	0,14	400 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	376	0,38
79 Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, fällig 01.07.2052	80	0,08	520 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,444 %, fällig 25.09.2034 *	26	0,03
507 Fannie Mae Pool 'CB5108', 5,500 %, fällig 01.11.2052	511	0,52	3 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	3	–
148 Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, fällig 01.01.2053	155	0,16	135 Freddie Mac Gold Pool 'G61637', 3,000 %, fällig 01.09.2047	119	0,12
342 Fannie Mae Pool 'CB6753', 6,000 %, fällig 01.07.2053	352	0,36	17 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, fällig 01.05.2043	16	0,02
83 Fannie Mae Pool 'CB8226', 6,500 %, fällig 01.03.2054	86	0,09	33 Freddie Mac Gold Pool 'Q29184', 4,000 %, fällig 01.10.2044	31	0,03
40 Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, fällig 01.02.2040	38	0,04	33 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig 01.01.2047	30	0,03
34 Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, fällig 01.02.2040	32	0,03	67 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig 01.01.2047	60	0,06
160 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	160	0,16	38 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01.01.2047	34	0,03
73 Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, fällig 01.03.2050	73	0,07	13 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	12	0,01
71 Fannie Mae Pool 'FM3049', 4,000 %, fällig 01.04.2044	69	0,07	42 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	39	0,04
91 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 01.11.2048	84	0,09	2.878 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Class X1, 0,716 %, fällig 25.12.2030 *	98	0,10
226 Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500 %, fällig 01.10.2040	201	0,20	3.983 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K130, Class X1, 1,036 %, fällig 25.06.2031 *	211	0,22
41 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, fällig 01.06.2038	38	0,04	10.397 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 157, Class X1, 0,254 %, fällig 25.05.2033 *	221	0,23
48 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	41	0,04	58 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,491 %, fällig 01.03.2047 *	55	0,06
66 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 01.03.2051	56	0,06	291 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,009 %, fällig 01.11.2048 *	283	0,29
59 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 01.06.2051	50	0,05	91 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 3,047 %, fällig 01.11.2047 *	92	0,09
46 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	44	0,04	95 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,107 %, fällig 01.02.2050 *	94	0,10
52 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 01.06.2048	50	0,05	65 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01.11.2050	55	0,06
74 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	63	0,06	69 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01.11.2050	59	0,06
134 Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, fällig 01.08.2051	119	0,12	62 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	0,05
69 Fannie Mae Pool 'FM8648', 3,000 %, fällig 01.09.2051	61	0,06	254 Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig 01.02.2051	207	0,21
73 Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, fällig 01.11.2051	65	0,07	72 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01.07.2051	61	0,06
72 Fannie Mae Pool 'FM9464', 3,000 %, fällig 01.11.2051	64	0,06	71 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01.08.2051	61	0,06
86 Fannie Mae Pool 'FP0028', 2,000 %, fällig 01.08.2040	74	0,08	227 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	192	0,20
67 Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, fällig 01.09.2051	57	0,06	79 Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, fällig 01.10.2051	70	0,07
62 Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, fällig 01.08.2051	55	0,06	381 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	325	0,33
74 Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, fällig 01.01.2052	66	0,07			
537 Fannie Mae Pool 'FS0273', 2,500 %, fällig 01.12.2051	459	0,47			
76 Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, fällig 01.01.2052	66	0,07			
– Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	–	–			
– Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01.02.2052	–	–			
– Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	–	–			
– Fannie Mae Pool 'FS0697', 2,500 %, fällig 01.02.2042	–	–			
78 Fannie Mae Pool 'FS0995', 2,500 %, fällig 01.03.2042	68	0,07			
– Fannie Mae Pool 'FS1014', 2,000 %, fällig 01.02.2052	–	–			
461 Fannie Mae Pool 'FS1074', 3,000 %, fällig 01.03.2052	409	0,42			
318 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, fällig 01.03.2052	260	0,27			
76 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 01.03.2052	68	0,07			
141 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	130	0,13			
75 Fannie Mae Pool 'FS3249', 5,000 %, fällig 01.11.2052	74	0,08			
74 Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, fällig 01.07.2041	78	0,08			
– Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, fällig 01.10.2051	–	–			
88 Fannie Mae Pool 'FS4805', 5,500 %, fällig 01.05.2053	88	0,09			
81 Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, fällig 01.07.2053	83	0,09			
956 Fannie Mae Pool 'FS5313', 3,500 %, fällig 01.01.2050	879	0,90			
258 Fannie Mae Pool 'FS5450', 3,000 %, fällig 01.11.2051	228	0,23			
– Fannie Mae Pool 'FS5647', 5,500 %, fällig 01.07.2053	–	–			
– Fannie Mae Pool 'FS6691', 1,500 %, fällig 01.03.2042	–	–			
81 Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, fällig 01.12.2053	84	0,09			
92 Fannie Mae Pool 'FS7170', 2,000 %, fällig 01.08.2042	79	0,08			
87 Fannie Mae Pool 'FS7624', 6,500 %, fällig 01.03.2054	90	0,09			
94 Fannie Mae Pool 'FS7997', 6,000 %, fällig 01.05.2054	96	0,10			
25 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 01.10.2042	24	0,02			
12 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 01.11.2042	12	0,01			
18 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	17	0,02			
32 Fannie Mae Pool 'MA2110', 3,500 %, fällig 01.12.2034	31	0,03			
22 Fannie Mae Pool 'MA2138', 3,500 %, fällig 01.01.2035	21	0,02			
43 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 01.07.2035	41	0,04			
71 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 01.02.2036	67	0,07			
53 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 01.04.2036	50	0,05			
127 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01.07.2036	120	0,12			
84 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, fällig 01.08.2036	79	0,08			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
228 Freddie Mac Pool 'RA6397', 2,500 %, fällig 01.11.2051	194	0,20	61 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Series T 56, Class 2AF, 4,866 %, fällig 25.05.2043 *	59	0,06
74 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig 01.01.2052	63	0,06	12 Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, fällig 15.07.2031	13	0,01
338 Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, fällig 01.01.2052	271	0,28	8 Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, fällig 15.08.2031	8	0,01
88 Freddie Mac Pool 'RA8790', 5,000 %, fällig 01.04.2053	87	0,09	2 Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, fällig 15.04.2032	2	–
344 Freddie Mac Pool 'RA9639', 6,000 %, fällig 01.08.2053	353	0,36	55 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	52	0,05
204 Freddie Mac Pool 'RB5105', 2,000 %, fällig 01.03.2041	177	0,18	30 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	27	0,03
222 Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, fällig 01.05.2041	185	0,19	46 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	42	0,04
225 Freddie Mac Pool 'RB5117', 1,500 %, fällig 01.07.2041	188	0,19	98 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	90	0,09
74 Freddie Mac Pool 'RB5121', 2,000 %, fällig 01.08.2041	64	0,07	5 Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, fällig 20.10.2040	5	0,01
297 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01.09.2041	254	0,26	5 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20.01.2041	5	0,01
93 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	77	0,08	3 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	4	–
677 Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, fällig 01.10.2041	583	0,60	13 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	13	0,01
47 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	39	0,04	6 Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, fällig 20.11.2041	7	0,01
81 Freddie Mac Pool 'RB5154', 2,500 %, fällig 01.04.2042	71	0,07	11 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	11	0,01
715 Freddie Mac Pool 'SD0502', 2,000 %, fällig 01.08.2050	630	0,64	364 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20.07.2047	344	0,35
62 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	51	0,05	9 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	9	0,01
77 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	65	0,07	90 Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, fällig 20.02.2048	83	0,08
375 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	357	0,36	109 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	96	0,10
86 Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, fällig 01.12.2052	87	0,09	21 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	19	0,02
79 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig 01.12.2052	81	0,08	49 Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, fällig 20.03.2051	39	0,04
85 Freddie Mac Pool 'SD2443', 4,500 %, fällig 01.10.2052	83	0,08	77 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20.03.2051	62	0,06
76 Freddie Mac Pool 'SD2452', 6,500 %, fällig 01.02.2053	79	0,08	145 Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, fällig 20.08.2051	124	0,13
90 Freddie Mac Pool 'SD2723', 5,500 %, fällig 01.03.2053	91	0,09	73 Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500 %, fällig 20.10.2051	62	0,06
86 Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, fällig 01.05.2053	87	0,09	152 Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500 %, fällig 20.11.2051	129	0,13
79 Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, fällig 01.03.2047	78	0,08	230 Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500 %, fällig 20.12.2051	196	0,20
386 Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, fällig 01.05.2053	400	0,41	78 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	69	0,07
86 Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, fällig 01.09.2051	73	0,07	78 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	68	0,07
262 Freddie Mac Pool 'SD3400', 4,500 %, fällig 01.10.2052	254	0,26	88 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	79	0,08
83 Freddie Mac Pool 'SD3432', 6,000 %, fällig 01.07.2053	86	0,09	83 Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	83	0,08
168 Freddie Mac Pool 'SD3642', 6,000 %, fällig 01.09.2053	173	0,18	88 Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, fällig 20.05.2053	87	0,09
166 Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, fällig 01.05.2053	165	0,17	87 Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, fällig 20.03.2051	70	0,07
90 Freddie Mac Pool 'SD5143', 6,000 %, fällig 01.04.2054	92	0,09	88 Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, fällig 20.08.2053	89	0,09
99 Freddie Mac Pool 'SD5691', 6,000 %, fällig 01.06.2054	101	0,10	85 Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000 %, fällig 20.03.2052	75	0,08
94 Freddie Mac Pool 'SD5709', 6,000 %, fällig 01.07.2054	96	0,10	269 Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, fällig 20.08.2053	272	0,28
96 Freddie Mac Pool 'SD5876', 6,000 %, fällig 01.05.2054	98	0,10	77 Ginnie Mae II Pool '786928', 6,500 %, fällig 20.09.2053	80	0,08
41 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	36	0,04	334 Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, fällig 20.09.2053	345	0,35
123 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	105	0,11	77 Ginnie Mae II Pool '787154', 6,500 %, fällig 20.11.2053	79	0,08
129 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	110	0,11	87 Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	90	0,09
497 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	423	0,43	76 Ginnie Mae II Pool '787236', 6,500 %, fällig 20.01.2054	78	0,08
108 Freddie Mac Pool 'SD8079', 2,000 %, fällig 01.07.2050	87	0,09	90 Ginnie Mae II Pool '787276', 6,000 %, fällig 20.02.2054	93	0,10
37 Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, fällig 01.01.2038	35	0,04	21 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20.10.2047	20	0,02
22 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	21	0,02	26 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	24	0,02
12 Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, fällig 01.11.2048	12	0,01	60 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	57	0,06
3 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	3	–	27 Ginnie Mae II Pool 'B51742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	26	0,03
39 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	35	0,04	97 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	85	0,09
3 Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 1,777 %, fällig 15.01.2040 *	–	–	24 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20.06.2044	22	0,02
18 Freddie Mac REMICS 3947, Class SG, 1,497 %, fällig 15.10.2041 *	2	–	9 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20.03.2045	8	0,01
10 Freddie Mac REMICS 4194, Class BI, 3,500 %, fällig 15.04.2043	1	–	90 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20.03.2046	84	0,09
1 Freddie Mac REMICS 4298, Class PI, 4,000 %, fällig 15.04.2043	–	–	48 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	45	0,05
26 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	23	0,02	12 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	11	0,01
400 Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	92	0,09	37 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	34	0,04
61 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	10	0,01	18 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	16	0,02
219 Freddie Mac REMICS 5010, Class JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	36	0,04	10 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20.12.2047	9	0,01
76 Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	13	0,01	16 Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, fällig 20.05.2048	16	0,02
153 Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	20	0,02	161 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	157	0,16
357 Freddie Mac REMICS 5038, Class PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	253	0,26	32 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	31	0,03
63 Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	9	0,01	51 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	49	0,05
384 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	65	0,07	13 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	13	0,01
68 Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	10	0,01	22 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	22	0,02
389 Freddie Mac REMICS 5085, Class NI, 2,000 %, fällig 25.03.2051	48	0,05	39 Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, fällig 20.12.2048	40	0,04
71 Freddie Mac REMICS 5092, Class AP, 2,000 %, fällig 25.04.2041	62	0,06	145 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	142	0,14
439 Freddie Mac REMICS 5093, Class IY, 4,500 %, fällig 25.12.2050	106	0,11	13 Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig 20.01.2049	13	0,01
164 Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	24	0,02	66 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	64	0,07
200 Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	183	0,19	16 Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, fällig 20.04.2049	16	0,02
109 Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	109	0,11	14 Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000 %, fällig 20.11.2049	14	0,01
106 Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	106	0,11	32 Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig 20.01.2050	32	0,03
420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 7,252 %, fällig 25.04.2042 *	436	0,45	213 Ginnie Mae II Pool 'MA7184', 2,000 %, fällig 20.02.2051	171	0,17
			157 Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, fällig 20.11.2052	158	0,16
			200 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	193	0,20
			700 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	691	0,71
			800 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	802	0,82
			4 Government National Mortgage Association, Series 2007 51, Class SG, 2,154 %, fällig 20.08.2037 *	–	–
			3 Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 5,576 %, fällig 20.11.2059 *	3	–
			3 Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,790 %, fällig 20.08.2058 *	3	–
			7 Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 4,890 %, fällig 20.11.2060 *	7	0,01
			10 Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 4,940 %, fällig 20.03.2061 *	10	0,01
			36 Government National Mortgage Association, Series 2012 27, Class IO, 0,211 %, fällig 16.04.2053 *	–	–
			14 Government National Mortgage Association, Series 2012 34, Class SA, 1,624 %, fällig 20.03.2042 *	1	–
			6 Government National Mortgage Association, Series 2012 44, Class IO, 0,032 %, fällig 16.03.2049 *	–	–
			5 Government National Mortgage Association, Series 2012 H18, Class NA, 4,960 %, fällig 20.08.2062 *	5	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
11 Government National Mortgage Association, Series 2012 H27, Class AI, 1,738 %, fällig 20.10.2062 *	–	–	123 New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Series 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.08.2055 *	118	0,12
6 Government National Mortgage Association, Series 2012 H30, Class GA, 4,790 %, fällig 20.12.2062 *	6	0,01	192 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	180	0,18
62 Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,792 %, fällig 16.11.2047 *	57	0,06	210 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	205	0,21
12 Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,012 %, fällig 16.02.2046 *	–	–	295 OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig 25.11.2063	297	0,30
29 Government National Mortgage Association, Series 2013 H08, Class BF, 4,840 %, fällig 20.03.2063 *	29	0,03	227 OBX 2024-NQM11 Trust, Series 2024 NQM11, Class A1, 144A, 5,875 %, fällig 25.06.2064	230	0,23
21 Government National Mortgage Association, Series 2014 105, Class IO, 0,134 %, fällig 16.06.2054 *	–	–	98 PFP 2024-11 Ltd, Series 2024 11, Class A, 144A, 6,143 %, fällig 17.09.2039 *	98	0,10
7 Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,536 %, fällig 16.06.2048 *	7	0,01	3 Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Class 1A1, 4,480 %, fällig 25.09.2037 *	3	–
9 Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,159 %, fällig 16.02.2048 *	–	–	300 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,138 %, fällig 15.12.2051 *	282	0,29
44 Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,589 %, fällig 16.09.2055 *	1	–	289 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A3, 2,807 %, fällig 15.11.2059	282	0,29
216 Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 4,870 %, fällig 20.10.2064 *	216	0,22	150 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A4, 3,065 %, fällig 15.11.2059	146	0,15
36 Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	7	0,01	1.338 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class XA, 1,161 %, fällig 15.11.2059 *	18	0,02
22 Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class MI, 5,500 %, fällig 20.03.2045	3	–	460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Class B, 4,188 %, fällig 15.11.2050 *	435	0,44
447 Government National Mortgage Association, Series 2015 5, Class IK, 0,230 %, fällig 16.11.2054 *	1	–	148 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class XA, 0,083 %, fällig 15.10.2057 *	–	–
59 Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050	8	0,01	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 46.757 \$)	45.918	46,90
135 Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	19	0,02	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 30,84 % (29. Februar 2024: 33,45 %)		
65 Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig 20.08.2050	9	0,01	Belgien – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,38 %)		
67 Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	10	0,01	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	57	0,06
70 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	10	0,01	60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	52	0,05
69 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	10	0,01	30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	31	0,03
4.240 Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,422 %, fällig 16.10.2060 *	403	0,41		140	0,14
4.311 Government National Mortgage Association, Series 2020 179, Class IO, 1,010 %, fällig 16.09.2062 *	321	0,33	Brasilien – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,86 %)		
324 Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	38	0,04	50 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	45	0,05
1.570 Government National Mortgage Association, Series 2020 195, Class IO, 0,924 %, fällig 16.12.2062 *	106	0,11	175 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	195	0,20
217 Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	42	0,04		240	0,25
124 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	23	0,02	Kanada – 0,18 % (29. Februar 2024: 0,47 %)		
129 Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class FP, 4,940 %, fällig 20.06.2069 *	128	0,13	80 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig 11.04.2025	80	0,08
175 Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 5,590 %, fällig 20.05.2070 *	181	0,18	70 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	65	0,07
74 Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 5,690 %, fällig 20.04.2070 *	75	0,08	10 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039	10	0,01
62 Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 4,890 %, fällig 20.07.2070 *	61	0,06	20 Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig 04.05.2032	19	0,02
5.709 Government National Mortgage Association, Series 2021 10, Class IO, 0,987 %, fällig 16.05.2063 *	431	0,44		174	0,18
136 Government National Mortgage Association, Series 2021 115, Class MI, 2,500 %, fällig 20.05.2051	16	0,02	China – 0,37 % (29. Februar 2024: 0,29 %)		
372 Government National Mortgage Association, Series 2021 188, Class PA, 2,000 %, fällig 20.10.2051	303	0,31	40 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	40	0,04
164 Government National Mortgage Association, Series 2021 2, Class AH, 1,500 %, fällig 16.06.2063	121	0,12	470 Prosus NV, 144A, 4,027 %, fällig 03.08.2050	324	0,33
76 Government National Mortgage Association, Series 2021 223, Class P, 2,000 %, fällig 20.06.2051	66	0,07		364	0,37
4.765 Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	377	0,39	Kolumbien – 0,26 % (29. Februar 2024: 0,26 %)		
200 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class B, 1,850 %, fällig 16.02.2061	107	0,11	350 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	253	0,26
846 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	38	0,04	Frankreich – 0,63 % (29. Februar 2024: 0,54 %)		
100 Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	84	0,09	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	199	0,20
299 Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	229	0,23	210 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	212	0,22
233 HOMES 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,915 %, fällig 25.07.2069	235	0,24	200 BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, fällig 05.12.2034 *	210	0,21
120 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class AS, 4,202 %, fällig 15.09.2047 *	118	0,12		621	0,63
259 Mill City Mortgage Trust 2015-2, Series 2015 2, Class M3, 144A, 3,724 %, fällig 25.09.2057 *	256	0,26	Deutschland – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
258 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, Series 2016 C30, Class A4, 2,600 %, fällig 15.09.2049	250	0,26	150 RWE Finance US LLC, 144A, 5,875 %, fällig 16.04.2034	154	0,16
217 Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 5,459 %, fällig 15.11.2034 *	216	0,22	Indien – 0,20 % (29. Februar 2024: 0,10 %)		
			270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12.01.2052	195	0,20
			Irland – 0,57 % (29. Februar 2024: 0,29 %)		
			230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	222	0,23
			360 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	338	0,34
				560	0,57
			Kasachstan – 0,36 % (29. Februar 2024 0,29 %)		
			360 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	356	0,36
			Mexiko – 0,70 % (29. Februar 2024: 0,67 %)		
			400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig 26.07.2033	327	0,33
			390 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	361	0,37
				688	0,70
			Niederlande – 0,26 % (29. Februar 2024: 0,66 %)		
			250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	249	0,26

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
Schweiz – 0,86 % (29. Februar 2024: 1,14 %)					
400 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	372	0,38	120 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	106	0,11
250 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	241	0,25	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	33	0,03
250 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	224	0,23	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	49	0,05
	837	0,86	190 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	189	0,19
Taiwan – 0,51 % (29. Februar 2024: 0,26 %)					
570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	502	0,51	300 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	300	0,31
Vereinigte Arabische Emirate – 0,44 % (29. Februar 2024: 0,33 %)					
450 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	428	0,44	90 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	90	0,09
Vereinigtes Königreich – 0,40 % (29. Februar 2024: 1,13 %)					
400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	395	0,40	140 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	139	0,14
USA – 24,55 % (29. Februar 2024: 24,46 %)					
10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,01	70 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	70	0,07
120 AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	121	0,12	220 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	215	0,22
390 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	367	0,38	50 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	45	0,05
50 AbbVie Inc, 4,950 %, fällig 15.03.2031	51	0,05	390 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	358	0,37
70 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	71	0,07	70 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	69	0,07
10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	9	0,01	37 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	33	0,03
50 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	51	0,05	10 Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18.05.2046	9	0,01
60 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	58	0,06	110 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	80	0,08
50 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	43	0,04	70 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	73	0,08
80 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	79	0,08	60 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	57	0,06
190 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	118	0,12	130 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	127	0,13
20 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	18	0,02	251 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	285	0,29
30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	26	0,03	10 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	8	0,01
11 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	10	0,01	20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	16	0,02
120 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	123	0,13	20 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	16	0,02
40 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	34	0,03	20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	16	0,02
50 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	41	0,04	10 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	8	0,01
10 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	10	0,01	211 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	133	0,14
10 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	10	0,01	20 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	12	0,01
37 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	31	0,03	10 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	9	0,01
28 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	24	0,02	20 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	19	0,02
90 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	63	0,06	30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	24	0,02
76 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	53	0,05	90 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	89	0,09
10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	0,01	210 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	213	0,22
63 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	44	0,04	170 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	167	0,17
10 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	10	0,01	140 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	138	0,14
193 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	186	0,19	40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	39	0,04
220 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	216	0,22	70 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	69	0,07
200 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	194	0,20	190 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	179	0,18
120 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	108	0,11	20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	17	0,02
130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	112	0,12	60 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	50	0,05
630 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	553	0,57	320 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	291	0,30
130 Bank of America Corp, 3,946 %, fällig 23.01.2049 *	104	0,11	17 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	14	0,01
40 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	32	0,03	50 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	40	0,04
70 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	60	0,06	109 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	109	0,11
360 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	337	0,34	150 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	149	0,15
210 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	200	0,20	80 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	80	0,08
70 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	46	0,05	18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	18	0,02
60 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	61	0,06	30 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	29	0,03
180 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	184	0,19	40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	38	0,04
50 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	42	0,04	30 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	26	0,03
30 Bristol-Myers Squibb Co, 5,550 %, fällig 22.02.2054	30	0,03	180 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	156	0,16
20 Bristol-Myers Squibb Co, 5,650 %, fällig 22.02.2064	20	0,02	210 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	199	0,20
200 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	167	0,17	30 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 24.03.2031	27	0,03
430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	363	0,37	60 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	57	0,06
50 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	53	0,06	160 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	159	0,16
3 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	3	–	50 Eli Lilly & Co, 4,600 %, fällig 14.08.2034	49	0,05
310 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	303	0,31	20 Eli Lilly & Co, 5,000 %, fällig 09.02.2054	19	0,02
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	80	0,08	140 Eli Lilly & Co, 5,100 %, fällig 09.02.2064	134	0,14
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	73	0,07	180 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	178	0,18
30 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,550 %, fällig 01.06.2034	31	0,03	160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	147	0,15
90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	82	0,08	320 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 31.01.2034	316	0,32
90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	88	0,09	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15.03.2044	18	0,02
10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	8	0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	15	0,02
			10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	7	0,01
			30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	29	0,03
			40 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	40	0,04
			140 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	151	0,15
			50 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	49	0,05
			180 FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	176	0,18
			90 FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	79	0,08
			50 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	52	0,05
			120 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	119	0,12
			70 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	71	0,07
			10 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	11	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
10 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	9	0,01	140 Solventum Corp, 5,600 %, fällig 23.03.2034	143	0,15
10 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	10	0,01	130 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	132	0,14
10 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	10	0,01	110 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	126	0,13
70 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	70	0,07	30 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	26	0,03
90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	89	0,09	2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	2	–
40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	39	0,04	230 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	210	0,21
630 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	621	0,64	160 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	146	0,15
30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	32	0,03	70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	61	0,06
150 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	141	0,14	30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	30	0,03
10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	9	0,01	30 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	28	0,03
10 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23.06.2025	10	0,01	10 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	10	0,01
80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	73	0,08	20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	20	0,02
30 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	27	0,03	280 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	268	0,27
130 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	104	0,11	50 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	44	0,05
20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	16	0,02	80 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	68	0,07
60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	43	0,04	70 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	70	0,07
20 Humana Inc, 4,500 %, fällig 01.04.2025	20	0,02	110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	81	0,08
20 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	20	0,02	30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	21	0,02
110 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	105	0,11	60 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig 15.05.2030	56	0,06
50 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	50	0,05	190 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	148	0,15
30 Intel Corp, 5,200 %, fällig 10.02.2033	30	0,03	20 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	20	0,02
110 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	91	0,09	130 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05.02.2030	118	0,12
20 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	12	0,01	110 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	77	0,08
130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	128	0,13	30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	29	0,03
110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	109	0,11	20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	17	0,02
210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	188	0,19	50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	48	0,05
150 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	132	0,13	120 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	87	0,09
65 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	61	0,06	50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2043	43	0,04
50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	34	0,04	40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	33	0,03
80 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	80	0,08	20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	17	0,02
100 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	100	0,10	50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	38	0,04
60 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	59	0,06	60 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	38	0,04
20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	20	0,02	20 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	15	0,02
40 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	41	0,04	20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	12	0,01
30 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	30	0,03	10 US Bancorp, Series mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	10	0,01
180 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	145	0,15	100 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	103	0,11
60 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	53	0,05	90 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	94	0,10
80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	76	0,08	150 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01.05.2030	133	0,14
70 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09.12.2045	65	0,07	100 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	98	0,10
20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	15	0,02	70 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	65	0,07
10 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	8	0,01	270 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	260	0,27
195 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	202	0,21	60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01.11.2034	57	0,06
80 Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig 15.01.2031	81	0,08	64 Verizon Communications Inc, 144A, 4,780 %, fällig 15.02.2035	63	0,06
50 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	52	0,05	20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	20	0,02
150 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	103	0,11	210 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	149	0,15
20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, fällig 15.05.2028	20	0,02	30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	23	0,02
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	110	0,11	10 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	9	0,01
160 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	156	0,16	80 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	63	0,06
100 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	91	0,09	70 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 23.02.2054	70	0,07
570 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	538	0,55	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,03
110 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	108	0,11	50 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	40	0,04
30 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	27	0,03	30 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	29	0,03
20 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	17	0,02	60 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, fällig 15.03.2029	57	0,06
20 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24.06.2025	20	0,02	90 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig 15.03.2032	81	0,08
60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	48	0,05	20 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	17	0,02
30 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	31	0,03	100 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	100	0,10
40 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	43	0,04	90 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	90	0,09
50 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	50	0,05	30 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig 25.07.2029 *	31	0,03
230 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	206	0,21	130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	119	0,12
60 Oracle Corp, 5,375 %, fällig 27.09.2054	56	0,06	120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	118	0,12
50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	47	0,05	220 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	198	0,20
50 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	43	0,04	180 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	150	0,15
20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	15	0,02	750 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	693	0,71
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	20	0,02	150 Williams Cos Inc/The, 5,150 %, fällig 15.03.2034	149	0,15
60 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig 01.06.2032	59	0,06		24.038	24,55
250 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	228	0,23	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen		
90 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	78	0,08	(Anschaffungskosten 31.760 \$)		
150 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	108	0,11		30.194	30,84
80 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	51	0,05	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 9,87 % (29. Februar 2024: 16,36 %)		
20 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	17	0,02	Chile – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,08 %)		
230 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	200	0,21	250 Internationale Staatsanleihe Chile, 3,100 %, fällig 22.01.2061	153	0,16
40 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	40	0,04	Kolumbien – 0,36 % (29. Februar 2024: 0,37 %)		
70 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	72	0,07	260 Kolumbien, Internationale Staatsanleihe, 3,250 %, fällig 22.04.2032	205	0,21
10 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	10	0,01	200 Kolumbien, Internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 26.02.2044	153	0,15
310 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	260	0,27		358	0,36
150 Shell Finance US Inc, 2,750 %, fällig 06.04.2030	138	0,14	Indien – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,22 %)		
10 Shell Finance US Inc, 4,550 %, fällig 12.08.2043	9	0,01	230 Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05.08.2026	226	0,23
260 Shell Finance US Inc, 4,000 %, fällig 10.05.2046	212	0,22	Israel – 0,36 % (29. Februar 2024: 0,37 %)		
20 Shell Finance US Inc, 3,250 %, fällig 06.04.2050	14	0,01	400 Israel, Internationale Staatsanleihe, Series 10Y, 2,750 %, fällig 03.07.2030	354	0,36
130 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	133	0,14			
130 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	133	0,14			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
Kasachstan – 0,19 % (29. Februar 2024 0,10 %)					
200 Kasachstan, Internationale Staatsanleihe, 4,875 %, fällig 14.10.2044	186	0,19	– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,00, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	11	0,01
Mexiko – 0,64 % (29. Februar 2024: 0,88 %)			– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,25, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	39	0,04
420 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 4,750 %, fällig 08.03.2044	332	0,34	– U.S. 10 Year April 2025 Put 108,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	1	–
420 Internationale Staatsanleihe Mexiko, 4,400 %, fällig 12.02.2052	297	0,30	– U.S. 10 Year Mai 2025 Put 107,50, fällig 25.04.2025 – Goldman Sachs	2	–
	629	0,64	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 111,00, fällig 07.03.2025 – Goldman Sachs	22	0,02
Peru – 0,27 % (29. Februar 2024: 0,24 %)			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,00, fällig 07.03.2025 – Goldman Sachs	3	–
40 Internationale Staatsanleihe Peru, 3,550 %, fällig 10.03.2051	28	0,03	– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	7	0,01
370 Internationale Staatsanleihe Peru, 3,600 %, fällig 15.01.2072	235	0,24	– U.S. 5 Year Mai 2025 Call 106,50, fällig 25.04.2025 – Goldman Sachs	43	0,05
	263	0,27	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 195 \$)	287	0,30
Südkorea – 0,32 % (29. Februar 2024: 0,27 %)			Credit Default Swaps – 0,21 % (29. Februar 2024: 0,25 %)		
310 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, fällig 24.02.2033	309	0,32	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	207	0,21
USA – 7,07 % (29. Februar 2024: 13,69 %)			Index-Swaps – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,48 %)		
1.440 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034	1.462	1,49	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	52	0,05
10 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.01.2028	10	0,01	Futures – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,08 %)		
90 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.12.2029	91	0,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	212	0,22
30 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	29	0,03	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	101.005	103,17
30 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2044	27	0,03			
10 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.02.2045	10	0,01	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
170 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	131	0,14	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – -1,29 % (29. Februar 2024: 0,40 %)		
320 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	246	0,25	-1,400 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	-1.170	-1,19
130 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	97	0,10	-100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	-96	-0,10
3.200 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	1.970	2,01	Total Mortgage-Backed Securities (Cost -1.234 \$)	-1.266	-1,29
50 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	26	0,03	Total Investments sold short at fair value through profit or loss (Cost -1.234 \$)	-1.266	-1,29
700 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	388	0,40			
520 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	346	0,35	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
230 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	148	0,15	Verkaufte Optionen – -0,16 % (29. Februar 2024: 0,04 %)		
1.980 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	1.501	1,53	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,5625, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	-21	-0,02
90 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	92	0,09	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,75, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	-16	-0,02
60 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	58	0,06	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Put 95,3750, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	-4	–
290 United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.11.2054	291	0,30	– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,50, fällig 13.06.2025 – Goldman Sachs	-7	-0,01
	6.923	7,07	– U.S. 10 Year April 2025 Call 109,00, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-18	-0,02
Uruguay – 0,27 % (29. Februar 2024: 0,14 %)			– U.S. 10 Year April 2025 Call 111,00, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-19	-0,02
220 Uruguay, Internationale Staatsanleihe, 7,625 %, fällig 21.03.2036	261	0,27	– U.S. 10 Year April 2025 Put 106,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	–	–
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 12.261 \$)	9.662	9,87	– U.S. 10 Year April 2025 Put 107,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-1	–
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,13 % (29. Februar 2024: 1,68 %)			– U.S. 10 Year Juni 2025 Call 112,50, fällig 23.05.2025 – Goldman Sachs	-28	-0,03
4.044 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	4.044	4,13	– U.S. 10 Year Mai 2025 Put 106,00, fällig 25.04.2025 – Goldman Sachs	-2	–
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.044 \$)	4.044	4,13	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 110,50, fällig 07.03.2025 – Goldman Sachs	-17	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 105.233 \$)	100.247	102,39	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 109,50, fällig 07.03.2025 – Goldman Sachs	-1	–
			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,50, fällig 07.03.2025 – Goldman Sachs	-4	–
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,25, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-6	-0,01
Gekaufte Optionen – 0,30 % (29. Februar 2024: 0,06 %)			– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,25, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-2	–
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,0625, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	18	0,02	– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	-9	-0,01
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,25, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	28	0,03	– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,00, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	–	–
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,3125, fällig 12.12.2025 – Goldman Sachs	42	0,04	– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,50, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	–	–
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Call 97,00, fällig 11.12.2026 – Goldman Sachs	44	0,05	– U.S. Bond April 2025 Put 109,00, fällig 21.03.2025 – Goldman Sachs	–	–
– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,00, fällig 13.06.2025 – Goldman Sachs	9	0,01	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -133 \$)	-155	-0,16
– CME 3 Month SOFR Futures September 2025 Call 96,1250, fällig 12.09.2025 – Goldman Sachs	18	0,02	Index-Swaps – -0,19 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-190	-0,19
			Futures – -0,02 % (29. Februar 2024: 0,04 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-20	-0,02

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.631	-1,66
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	99.374	101,51
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-1.472	-1,51
Gesamtvermögen	97.902 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 19.711.000 \$ und machten 20,13 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.
- ± 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 28. Februar 2025.

ABKÜRZUNGEN:

- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit
TBA – To be announced

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,29
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,80
Derivative Finanzinstrumente	0,71
Sonstige Vermögenswerte	5,20
Gesamtvermögen	100,00

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. 2034	3.627	\$ 23
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	8.500	184
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 462 \$)				\$ 207
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 462 \$)				\$ 207

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 4,060 %, Erhalt variabler aufgezinster SOFR (USD)	30. Nov. 2031	7.670	\$ -142
Goldman Sachs	Zahlung Festzins 4,220 %, Erhalt variabler aufgezinster SOFR (USD)	17. Jan. 2036	1.387	-48
Goldman Sachs	Zahl variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 4,100 %	17. Jan. 2028	5.892	52
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 884 \$)				\$ 52
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1 \$)				-190
Nettowertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 883 \$)				\$ -138

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Goldman Sachs	67	\$ 16.133	\$ 18
3 Month SOFR Index Dezember 2026	Goldman Sachs	28	6.751	19
3 Month SOFR Index September 2025	Goldman Sachs	-11	-2.645	-6
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	41	4.555	51
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	28	5.795	29
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	128	13.816	83
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	6	708	12
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	-4	-496	-14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 156 \$)				\$ 212
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -75 \$)				-20
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 81 \$)				\$ 192

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 6,70 % (29. Februar 2024: 6,14 %)					
1.380 CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class A1, 144A, 5,961 %, fällig 20.10.2037 *	1.389	0,56	46 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	9	–
832 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	729	0,29	44 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C22, 4,500 %, fällig 25.11.2039	8	–
153 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Series 2017 SR01, Class A3, 3,089 %, fällig 25.11.2027	148	0,06	559 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	90	0,04
2.340 Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class A1, 144A, 6,112 %, fällig 25.10.2037 *	2.352	0,95	3.100 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	2.480	1,00
933 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 5,184 %, fällig 25.02.2034 *	921	0,37	2.200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 % ±	1.839	0,74
2.170 Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	1.672	0,67	10.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 % ±	9.148	3,68
3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	165	0,07	3.800 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	3.447	1,39
1.642 Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class AV3, 5,374 %, fällig 25.05.2034 *	1.469	0,59	2.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 % ±	2.344	0,94
2 SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2048	421	0,17	1.000 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	962	0,39
1.537 SMB Private Education Loan Trust 2024-A, Series 2024 A, Class A1A, 144A, 5,240 %, fällig 15.03.2056	1.561	0,63	2.300 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	2.263	0,91
238 SMB Private Education Loan Trust, Series 2020 B, Class A1A, 144A, 1,290 %, fällig 15.07.2053	223	0,09	3.800 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	3.805	1,53
1.147 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	1.101	0,44	2.500 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,000 % ±	2.541	1,02
880 Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Series 2005 HE1, Class M2, 5,154 %, fällig 25.07.2035 *	839	0,34	1.200 Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,500 % ±	1.236	0,50
399 Subway Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2I, 144A, 6,028 %, fällig 30.07.2054	409	0,16	3 Fannie Mae Pool '843997', 6,585 %, fällig 01.11.2035 *	3	–
1.387 Subway Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2II, 144A, 6,268 %, fällig 30.07.2054	1.439	0,58	3 Fannie Mae Pool '865915', 6,747 %, fällig 01.03.2036 *	3	–
380 Sycamore Tree CLO 2025-6 Ltd, Series 2025 6A, Class A1, 144A, 0,000 %, fällig 20.04.2038 *	380	0,15	96 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig 01.12.2037	91	0,04
910 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class A1, 144A, 5,780 %, fällig 23.07.2037 *	918	0,37	11 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01.08.2038	12	–
530 Venture 38 CLO Ltd, Series 2019 38A, Class ARR, 144A, 0,000 %, fällig 30.07.2032 *	530	0,21	77 Fannie Mae Pool 'AM3347', 3,310 %, fällig 05.01.2033	71	0,03
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 19.061 \$)	16.666	6,70	10 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 04.01.2025	10	–
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 44,55 % (29. Februar 2024: 43,18 %)					
1.000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class A, 144A, 5,491 %, fällig 15.09.2034 *	993	0,40	185 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 09.01.2042	168	0,07
35 Alternative Loan Trust 2006-18CB, Series 2006 18CB, Class A6, 10,865 %, fällig 25.07.2036 *	30	0,01	203 Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 10.01.2046	181	0,07
995 AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 6,554 %, fällig 17.06.2039 *	995	0,40	700 Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 02.01.2056	666	0,27
1.763 Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2, Class 2A2, 144A, 4,648 %, fällig 26.05.2037 *	1.557	0,63	414 Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	389	0,16
1.790 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	1.733	0,70	601 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 09.01.2057	582	0,23
11.299 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class XA, 0,677 %, fällig 15.09.2060 *	155	0,06	31 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 08.01.2058	30	0,01
1.030 BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3, 688 %, fällig 15.02.2061	1.000	0,40	237 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	228	0,09
1.500 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,663 %, fällig 15.11.2061 *	1.461	0,59	58 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 12.01.2037	53	0,02
1.045 BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A1, 144A, 5,803 %, fällig 25.06.2064	1.052	0,42	582 Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, fällig 04.01.2047	520	0,21
41 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 1A2, 5,014 %, fällig 25.04.2035 *	39	0,02	34 Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, fällig 08.01.2047	30	0,01
530 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, Series 2016 C1, Class A4, 3,209 %, fällig 10.05.2049	520	0,21	245 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 11.01.2048	240	0,10
65.087 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,913 %, fällig 15.11.2049 *	731	0,29	784 Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 12.01.2048	770	0,31
1.064 COLT 2024-3 Mortgage Loan Trust, Series 2024 3, Class A2, 144A, 6,646 %, fällig 25.06.2069	1.077	0,43	99 Fannie Mae Pool 'BO1858', 3,000 %, fällig 08.01.2049	88	0,04
90 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class B, 4,035 %, fällig 10.02.2048 *	87	0,04	181 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	149	0,06
1.047 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	1.045	0,42	311 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	252	0,10
840 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R08, Series 2023 R08, Class 1M2, 144A, 6,852 %, fällig 25.10.2043 *	868	0,35	1.890 Fannie Mae Pool 'CA7240', 2,500 %, fällig 01.10.2050	1.608	0,65
710 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R02, Series 2024 R02, Class 1M2, 144A, 6,152 %, fällig 25.02.2044 *	718	0,29	351 Fannie Mae Pool 'CB0100', 2,500 %, fällig 04.01.2041	310	0,12
500 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class A5, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	495	0,20	317 Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, fällig 07.01.2052	318	0,13
1.050 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037	965	0,39	819 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	822	0,33
1.960 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class M2, 144A, 2,974 %, fällig 25.07.2057 *	1.554	0,63	735 Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500 %, fällig 03.01.2038	676	0,27
128 Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Class 3AF1, 144A, 4,706 %, fällig 15.04.2036 *	118	0,05	153 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 11.01.2048	146	0,06
178 Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Series 2017 T1, Class A, 2,898 %, fällig 25.06.2027	172	0,07	160 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 02.01.2051	136	0,05
			38 Fannie Mae Pool 'FM5754', 3,500 %, fällig 03.01.2037	37	0,01
			192 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	163	0,07
			83 Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500 %, fällig 08.01.2039	80	0,03
			2.161 Fannie Mae Pool 'FM6597', 2,000 %, fällig 03.01.2041	1.870	0,75
			64 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 06.01.2051	55	0,02
			104 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 06.01.2048	100	0,04
			288 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 07.01.2051	245	0,10
			297 Fannie Mae Pool 'FS0697', 2,500 %, fällig 02.01.2042	261	0,11
			80 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 04.01.2052	68	0,03
			78 Fannie Mae Pool 'FS1726', 2,000 %, fällig 09.01.2041	68	0,03
			354 Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, fällig 02.01.2053	356	0,14
			403 Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, fällig 07.01.2053	416	0,17
			170 Fannie Mae Pool 'FS7902', 6,500 %, fällig 12.01.2053	178	0,07
			566 Fannie Mae Pool 'FS7997', 6,000 %, fällig 05.01.2054	576	0,23
			6 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 04.01.2031	6	–
			25 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 05.01.2031	25	0,01
			7 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 06.01.2031	7	–
			11 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 11.01.2031	11	–
			11 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 12.01.2031	11	–
			43 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 07.01.2035	41	0,02
			414 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 02.01.2036	388	0,16
			318 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 04.01.2036	299	0,12
			636 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 07.01.2036	599	0,24
			158 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig 03.01.2042	134	0,05
			59 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Class ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	61	0,02
			59 Fannie Mae REMICS, Series 2012 133, Class CS, 1,684 %, fällig 25.12.2042 *	6	–
			2 Fannie Mae REMICS, Series 2012 28, Class B, 6,500 %, fällig 25.06.2039	2	–
			115 Fannie Mae REMICS, Series 2012 35, Class SC, 2,034 %, fällig 25.04.2042 *	13	0,01
			30 Fannie Mae REMICS, Serie 2012 46, Klasse BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	31	0,01
			43 Fannie Mae REMICS, Series 2012 51, Class B, 7,000 %, fällig 25.05.2042	47	0,02
			117 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	123	0,05
			136 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	139	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
850 Fannie Mae REMICS, Series 2016 23, Class ST, 1,534 %, fällig 25.11.2045 *	90	0,04	109 Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	109	0,04
114 Fannie Mae REMICS, Series 2016 61, Class BS, 1,634 %, fällig 25.09.2046 *	8	–	106 Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	106	0,04
685 Fannie Mae REMICS, Series 2017 76, Class SB, 1,634 %, fällig 25.10.2057 *	86	0,03	950 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B1, 144A, 7,752 %, fällig 25.10.2041 *	982	0,40
1.700 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class AQ, 2,000 %, fällig 25.08.2050	1.345	0,54	565 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M1B, 144A, 6,752 %, fällig 25.02.2042 *	579	0,23
1.901 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	303	0,12	34 Freddie Mac Strips 334, Class S7, 1,647 %, fällig 15.08.2044 *	3	–
800 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	753	0,30	24 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	25	0,01
1.648 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,444 %, fällig 25.09.2034 *	83	0,03	41 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	42	0,02
100 Fannie Mae-Aces, Series 2023 M4, Class A2, 3,768 %, fällig 25.09.2032 *	95	0,04	42 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	38	0,02
51 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01.04.2038	47	0,02	329 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	310	0,13
674 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	604	0,24	60 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	55	0,02
668 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig 01.01.2047	598	0,24	146 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	134	0,05
190 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01.01.2047	170	0,07	307 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	280	0,11
6.199 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Class X1, 0,900 %, fällig 25.08.2026 *	67	0,03	204 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	186	0,07
8.991 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K128, Class X1, 0,512 %, fällig 25.03.2031 *	224	0,09	1 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, fällig 15.11.2042	1	–
4.879 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K131, Class X1, 0,727 %, fällig 25.07.2031 *	189	0,08	174 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	157	0,06
7.770 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K144, Class X1, 0,326 %, fällig 25.04.2032 *	168	0,07	11 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	11	–
10.753 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 150, Class X1, 0,310 %, fällig 25.09.2032 *	241	0,10	4 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20.07.2040	4	–
43 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,491 %, fällig 01.03.2047 *	41	0,02	42 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, fällig 20.07.2041	42	0,02
432 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 3,047 %, fällig 01.11.2047 *	436	0,18	66 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	60	0,02
40 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	35	0,01	508 Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, fällig 20.02.2048	470	0,19
195 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 02.01.2051	158	0,06	383 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	336	0,14
248 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 02.01.2051	202	0,08	62 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	58	0,02
126 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 02.01.2051	103	0,04	671 Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500 %, fällig 20.06.2051	571	0,23
72 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 05.01.2051	62	0,03	871 Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, fällig 20.08.2051	742	0,30
360 Freddie Mac Pool 'QC6551', 2,500 %, fällig 09.01.2051	306	0,12	808 Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, fällig 20.09.2052	783	0,32
175 Freddie Mac Pool 'QG7311', 5,500 %, fällig 07.01.2053	177	0,07	672 Ginnie Mae II Pool '786366', 4,500 %, fällig 20.08.2052	650	0,26
67 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig 04.01.2041	59	0,02	584 Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	582	0,23
447 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig 01.01.2052	381	0,15	263 Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, fällig 20.05.2053	262	0,11
163 Freddie Mac Pool 'RA9079', 6,500 %, fällig 05.01.2053	171	0,07	433 Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, fällig 20.03.2051	350	0,14
154 Freddie Mac Pool 'RA9080', 6,500 %, fällig 05.01.2053	161	0,06	88 Ginnie Mae II Pool '786823', 5,500 %, fällig 20.07.2053	89	0,04
55 Freddie Mac Pool 'RB5071', 2,000 %, fällig 09.01.2040	47	0,02	440 Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, fällig 20.08.2053	443	0,18
1.458 Freddie Mac Pool 'RB5084', 1,500 %, fällig 11.01.2040	1.218	0,49	319 Ginnie Mae II Pool '787214', 6,500 %, fällig 20.01.2054	329	0,13
749 Freddie Mac Pool 'RB5105', 2,000 %, fällig 03.01.2041	648	0,26	697 Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	718	0,29
854 Freddie Mac Pool 'SC0160', 2,000 %, fällig 07.01.2041	738	0,30	93 Ginnie Mae II Pool '787259', 2,000 %, fällig 20.02.2051	75	0,03
288 Freddie Mac Pool 'SC0188', 2,000 %, fällig 09.01.2041	249	0,10	814 Ginnie Mae II Pool '787276', 6,000 %, fällig 20.02.2054	839	0,34
510 Freddie Mac Pool 'SC0206', 2,000 %, fällig 11.01.2041	442	0,18	720 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, fällig 20.10.2045	688	0,28
78 Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, fällig 01.01.2042	68	0,03	79 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20.10.2049	75	0,03
1.117 Freddie Mac Pool 'SC0384', 2,000 %, fällig 01.04.2042	960	0,39	60 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	57	0,02
44 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 07.01.2047	42	0,02	54 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	51	0,02
176 Freddie Mac Pool 'SD2138', 5,500 %, fällig 01.01.2053	177	0,07	290 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	255	0,10
690 Freddie Mac Pool 'SD2688', 5,500 %, fällig 01.04.2053	696	0,28	87 Ginnie Mae II Pool 'CI1513', 3,000 %, fällig 20.03.2052	76	0,03
588 Freddie Mac Pool 'SD3642', 6,000 %, fällig 09.01.2053	607	0,24	300 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 % ±	246	0,10
339 Freddie Mac Pool 'SD4030', 6,500 %, fällig 10.01.2053	354	0,14	300 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 % ±	275	0,11
91 Freddie Mac Pool 'SD5094', 5,500 %, fällig 08.01.2053	92	0,04	200 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 % ±	193	0,08
1.096 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 02.01.2051	938	0,38	1.800 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	1.778	0,71
1 Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, fällig 07.01.2025	1	–	2.700 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 % ±	2.707	1,09
129 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig 01.01.2038	123	0,05	300 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,500 % ±	306	0,12
39 Freddie Mac Reference REMIC R007, Class ZA, 6,000 %, fällig 15.05.2036	41	0,02	53 Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 5,576 %, fällig 20.11.2059 *	53	0,02
27 Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 1,777 %, fällig 15.01.2040 *	2	–	198 Government National Mortgage Association, Series 2010 H11, Class FA, 5,430 %, fällig 20.06.2060 *	199	0,08
2.399 Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	550	0,22	89 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 4,770 %, fällig 20.10.2060 *	89	0,04
486 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	78	0,03	1 Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 4,790 %, fällig 20.05.2059 *	1	–
1.757 Freddie Mac REMICS 5093, Class IY, 4,500 %, fällig 25.12.2050	422	0,17	161 Government National Mortgage Association, Series 2010 H24, Class FA, 4,790 %, fällig 20.10.2060 *	160	0,06
1.306 Freddie Mac REMICS 5115, Class IO, 4,500 %, fällig 25.10.2049	292	0,12	3 Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,790 %, fällig 20.08.2058 *	3	–
664 Freddie Mac REMICS 5159, Class IP, 3,000 %, fällig 25.11.2051	98	0,04	10 Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 4,940 %, fällig 20.03.2061 *	10	–
538 Freddie Mac REMICS 5168, Class CI, 4,000 %, fällig 25.11.2051	112	0,05	250 Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,792 %, fällig 16.11.2047 *	228	0,09
1.200 Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	1.096	0,44	3.968 Government National Mortgage Association, Series 2013 50, Class IO, 0,064 %, fällig 16.10.2048 *	6	–
			759 Government National Mortgage Association, Series 2014 169, Class IO, 0,596 %, fällig 16.10.2056 *	17	0,01
			36 Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,536 %, fällig 16.06.2048 *	35	0,01
			177 Government National Mortgage Association, Series 2014 176, Class IA, 4,000 %, fällig 20.11.2044	36	0,01
			849 Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 4,870 %, fällig 20.10.2064 *	850	0,34
			376 Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	74	0,03
			644 Government National Mortgage Association, Series 2015 183, Class IO, 0,438 %, fällig 16.09.2057 *	14	0,01
			357 Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Class SB, 1,674 %, fällig 16.10.2046 *	44	0,02
			636 Government National Mortgage Association, Series 2016 21, Class ST, 1,724 %, fällig 20.02.2046 *	77	0,03
			301 Government National Mortgage Association, Series 2016 84, Class IG, 4,500 %, fällig 16.11.2045	69	0,03
			922 Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,526 %, fällig 16.02.2059 *	28	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)			Frankreich – 0,79 % (29. Februar 2024: 1,49 %)		
1.038 Government National Mortgage Association, Series 2017 132, Class IA, 4,500 %, fällig 20.09.2047	199	0,08	360 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	363	0,14
780 Government National Mortgage Association, Series 2017 157, Class IO, 0,520 %, fällig 16.12.2059 *	26	0,01	590 BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, fällig 05.12.2034 *	621	0,25
742 Government National Mortgage Association, Series 2017 28, Class IO, 0,701 %, fällig 16.02.2057 *	28	0,01	710 BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, Ewige Anleihe *	753	0,30
423 Government National Mortgage Association, Series 2017 41, Class IO, 0,563 %, fällig 16.07.2058 *	11	–	250 Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, fällig 10.01.2033 *	240	0,10
89 Government National Mortgage Association, Series 2017 H15, Class KI, 2,340 %, fällig 20.07.2067 *	5	–		1.977	0,79
3.322 Government National Mortgage Association, Series 2017 H18, Class BI, 1,949 %, fällig 20.09.2067 *	108	0,04	Deutschland – 0,42 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
41 Government National Mortgage Association, Series 2017 H20, Class IB, 2,494 %, fällig 20.10.2067 *	1	–	510 RWE Finance US LLC, 144A, 5,875 %, fällig 16.04.2034	522	0,21
95 Government National Mortgage Association, Series 2018 H06, Class PF, 4,740 %, fällig 20.02.2068 *	95	0,04	550 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	532	0,21
651 Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	126	0,05		1.054	0,42
248 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	47	0,02	Indien – 0,15 % (29. Februar 2024: 0,13 %)		
1.774 Government National Mortgage Association, Series 2021 21, Class AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	1.302	0,52	520 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 01.12.2052	376	0,15
961 Government National Mortgage Association, Series 2021 77, Class LC, 1,250 %, fällig 20.07.2050	746	0,30	Irland – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,33 %)		
1.500 Government National Mortgage Association, Series 2022 139, Class AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	1.366	0,55	660 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	620	0,25
1.693 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	75	0,03	Israel – 0,34 % (29. Februar 2024: 0,39 %)		
1.990 Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	108	0,04	590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	571	0,23
1.157 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 6,159 %, fällig 15.09.2031 *	893	0,36	240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	269	0,11
12 HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Series 2007 7, Class 2A1A, 6,434 %, fällig 25.10.2037 *	12	–		840	0,34
818 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Series 2016 NINE, Class A, 144A, 2,854 %, fällig 06.09.2038 *	793	0,32	Japan – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,37 %)		
274 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	257	0,10	690 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025	682	0,27
2.694 Towd Point Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class B1, 144A, 6,234 %, fällig 25.02.2057 *	2.725	1,10	300 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	295	0,12
690 UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Series 2017 C2, Class A4, 3,487 %, fällig 15.08.2050	668	0,27		977	0,39
422 UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7, Series 2017 C7, Class A3, 3,418 %, fällig 15.12.2050	409	0,16	Kasachstan – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,08 %)		
71.675 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Series 2018 C9, Class XA, 0,914 %, fällig 15.03.2051 *	1.635	0,66	320 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24.10.2048	303	0,12
122 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, Series 2007 OA2, Class 2A, 5,484 %, fällig 25.03.2047 *	112	0,05	Kuwait – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,04 %)		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 114.187 \$)	110.827	44,55	320 EQUATE Petrochemical Co KSC, 144A, 4,250 %, fällig 03.11.2026	314	0,13
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 33,05 % (29. Februar 2024: 36,66 %)			Luxemburg – 0,20 % (29. Februar 2024: 0,07 %)		
Australien – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,04 %)			620 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	487	0,20
40 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	38	0,01	Macau – 0,67 % (29. Februar 2024: 0,43 %)		
Belgien – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,43 %)			880 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	880	0,35
28 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	26	0,01	510 Sands China Ltd, 2,300 %, fällig 03.08.2027	483	0,20
Brasilien – 0,20 % (29. Februar 2024: 0,65 %)			340 Sands China Ltd, 2,850 %, fällig 03.08.2029	308	0,12
510 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	435	0,18		1.671	0,67
50 Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	55	0,02	Mexiko – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,13 %)		
	490	0,20	20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01.03.2035	22	0,01
Kanada – 0,29 % (29. Februar 2024: 0,43 %)			10 America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15.11.2037	11	0,01
20 Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	19	0,01	330 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig 11.05.2031	274	0,11
120 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	112	0,04	330 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	305	0,12
40 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	40	0,01		612	0,25
190 Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2043	194	0,08	Marokko – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,12 %)		
200 Rogers Communications Inc, 5,300 %, fällig 15.02.2034	198	0,08	270 OCP SA, 144A, 5,125 %, fällig 23.06.2051	211	0,08
20 Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	20	0,01	Niederlande – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,52 %)		
120 Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, fällig 08.06.2032	116	0,05	600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	587	0,24
20 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	20	0,01	Supranational – 0,66 % (29. Februar 2024: 0,44 %)		
	719	0,29	INR 142.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	1.652	0,66
China – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,32 %)			Schweiz – 0,93 % (29. Februar 2024: 1,34 %)		
40 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	40	0,02	270 UBS Group AG, 144A, 4,488 %, fällig 12.05.2026 *	270	0,11
420 Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08.02.2051	279	0,11	300 UBS Group AG, 144A, 2,193 %, fällig 05.06.2026 *	298	0,12
	319	0,13	420 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	405	0,16
Kolumbien – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,18 %)			720 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	644	0,26
640 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	545	0,22	200 UBS Group AG, 144A, 2,746 %, fällig 11.02.2033 *	172	0,07
Dänemark – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,27 %)			250 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	290	0,11
550 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	546	0,22	220 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	241	0,10
				2.320	0,93
			Vereinigte Arabische Emirate – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,09 %)		
			360 DP World Ltd.United Arab Emirates, 5,625 %, fällig 25.09.2048	342	0,14
			Vereinigtes Königreich – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,85 %)		
			400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19.06.2029 *	397	0,16
			USA – 25,77 % (29. Februar 2024: 26,89 %)		
			1.330 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	1.253	0,50
			60 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	61	0,02
			10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	–
			710 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	643	0,26
			50 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	49	0,02
			150 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	129	0,05
			34 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	30	0,01
			290 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	297	0,12
			90 APA Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.12.2029	98	0,04
			17 APA Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2037	17	0,01
			240 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	229	0,09

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	127	0,05	93 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	73	0,03
60 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	49	0,02	69 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	43	0,02
50 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	49	0,02	50 Comcast Corp, 5,350 %, fällig 15.05.2053	48	0,02
190 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	190	0,08	7 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	4	–
161 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	136	0,06	20 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	12	0,01
208 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	176	0,07	20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	17	0,01
10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	–	98 CommScope LLC, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	88	0,04
25 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	17	0,01	240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	226	0,09
120 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	119	0,05	120 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	96	0,04
330 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	329	0,13	1.110 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	1.091	0,44
130 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig 27.04.2028 *	129	0,05	300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	221	0,09
470 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	454	0,18	200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	142	0,06
750 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	736	0,30	510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	374	0,15
1.090 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	942	0,38	8 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	8	–
660 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	580	0,23	530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	500	0,20
270 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	229	0,09	100 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	83	0,03
320 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	259	0,10	570 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	517	0,21
30 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	30	0,01	94 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	77	0,03
37 Becton Dickinson & Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	33	0,01	50 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	44	0,02
1.790 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	1.673	0,67	11 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 10.12.2028	11	–
310 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	295	0,12	7 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig 10.01.2030	8	–
20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	13	0,01	10 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	10	–
43 Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, fällig 22.06.2047	35	0,01	40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	38	0,02
280 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	286	0,12	320 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	274	0,11
430 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	439	0,18	290 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	251	0,10
60 Bristol-Myers Squibb Co, 5,550 %, fällig 22.02.2054	60	0,02	50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	49	0,02
50 Bristol-Myers Squibb Co, 5,650 %, fällig 22.02.2064	50	0,02	160 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	151	0,06
540 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	450	0,18	100 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	81	0,03
330 Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	293	0,12	260 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	232	0,09
200 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	169	0,07	230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	217	0,09
30 Carrier Global Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2031	27	0,01	40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	36	0,01
280 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	252	0,10	140 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	95	0,04
770 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	679	0,27	40 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	40	0,02
360 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	351	0,14	40 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2029	39	0,02
180 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	173	0,07	30 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	26	0,01
50 Centene Corp, 3,000 %, fällig 15.10.2030	44	0,02	10 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	12	0,01
210 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	214	0,09	50 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	47	0,02
180 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	193	0,08	20 Elevance Health Inc, 4,550 %, fällig 15.05.2052	17	0,01
3 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	3	–	710 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	704	0,28
780 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	763	0,31	300 Eli Lilly & Co, 4,600 %, fällig 14.08.2034	296	0,12
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	99	0,04	80 Eli Lilly & Co, 5,000 %, fällig 09.02.2054	77	0,03
440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,550 %, fällig 01.06.2034	456	0,18	190 Eli Lilly & Co, 5,100 %, fällig 09.02.2064	181	0,07
350 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	320	0,13	420 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	387	0,16
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	253	0,10	830 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 31.01.2034	821	0,33
70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	59	0,02	170 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	139	0,06
130 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	115	0,05	10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	7	–
10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	8	–	220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	216	0,09
40 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig 01.03.2031	38	0,02	90 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	89	0,04
280 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	247	0,10	20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	20	0,01
370 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	367	0,15	260 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	256	0,10
30 Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	28	0,01	200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	201	0,08
20 Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	20	0,01	120 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	110	0,04
300 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	298	0,12	400 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	335	0,14
700 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	679	0,27	400 FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	392	0,16
1.170 Citigroup Inc, 4,075 %, fällig 23.04.2029 *	1.150	0,46	440 FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	386	0,16
1.480 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	1.443	0,58	120 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	124	0,05
20 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03.11.2032 *	17	0,01	270 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	267	0,11
10 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	10	–	210 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 04.11.2027	219	0,09
5 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	5	–	200 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 06.03.2030	212	0,09
20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	15	0,01	500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	437	0,18
170 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	178	0,07	470 Foundry JV Holdco LLC, 144A, 5,875 %, fällig 25.01.2034	482	0,19
280 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	264	0,11	80 Fox Corp, 6,500 %, fällig 13.10.2033	86	0,03
310 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	304	0,12	240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	242	0,10
13 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	14	0,01	170 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	162	0,07
310 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	269	0,11	190 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	192	0,08
300 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	249	0,10	50 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	47	0,02
260 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	206	0,08	50 General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17.01.2027	50	0,02
			30 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	28	0,01
			160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	157	0,06
			870 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	848	0,34
			210 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	207	0,08
			1.000 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	865	0,35
			100 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	108	0,04
			40 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	38	0,02
			360 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	326	0,13
			60 Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15.11.2035	58	0,02
			60 Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	55	0,02
			10 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.04.2025	10	–
			20 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	20	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
30 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.09.2026	30	0,01	315 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	379	0,15
10 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	10	–	30 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	28	0,01
570 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	530	0,21	80 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	79	0,03
440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	402	0,16	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	185	0,07
360 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	289	0,12	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	18	0,01
90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	73	0,03	80 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	73	0,03
20 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	14	0,01	280 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	296	0,12
80 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	79	0,03	20 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	19	0,01
40 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	37	0,02	660 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	632	0,25
10 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	8	–	10 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	9	–
10 Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	9	–	380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	339	0,14
20 Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	17	0,01	90 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	83	0,03
50 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 6,399 %, fällig 21.12.2065 *	43	0,02	10 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	9	–
220 Intel Corp, 1,600 %, fällig 12.08.2028	198	0,08	10 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	10	–
180 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	181	0,07	50 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	37	0,02
60 Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	43	0,02	10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	7	–
10 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	8	–	10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	10	–
30 Intel Corp, 5,700 %, fällig 10.02.2053	28	0,01	500 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	414	0,17
880 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	854	0,34	370 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	277	0,11
340 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	335	0,14	690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	666	0,27
780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	775	0,31	420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	376	0,15
440 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	395	0,16	280 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	284	0,11
10 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	9	–	140 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	123	0,05
60 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	60	0,02	110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	96	0,04
10 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	10	–	400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	384	0,15
10 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	9	–	160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	132	0,05
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2043	30	0,01	310 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	264	0,11
130 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	128	0,05	110 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	83	0,03
110 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	109	0,04	20 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	15	0,01
220 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	226	0,09	20 US Bancorp, Series mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	19	0,01
160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Nullkupon, Ewige Anleihe	–	–	320 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	330	0,13
30 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	24	0,01	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	10	–
130 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	124	0,05	410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	357	0,14
270 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	221	0,09	150 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	140	0,06
160 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	166	0,07	174 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	153	0,06
320 Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig 15.01.2031	324	0,13	250 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	241	0,10
10 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	10	–	247 Verizon Communications Inc, 144A, 4,780 %, fällig 15.02.2035	241	0,10
10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	7	–	410 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	413	0,17
400 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	391	0,16	400 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	284	0,11
830 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	752	0,30	180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	141	0,06
350 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	331	0,13	80 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	65	0,03
80 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	69	0,03	50 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	46	0,02
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	20	0,01	50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	50	0,02
260 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	231	0,09	80 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	63	0,03
210 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	161	0,07	70 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	51	0,02
10 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	10	–	10 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 23.02.2054	10	–
50 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	49	0,02	50 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	44	0,02
360 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	335	0,13	30 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	34	0,01
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	293	0,12	300 Warnermedia Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	293	0,12
240 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	251	0,10	190 Warnermedia Holdings Inc, 4,054 %, fällig 15.03.2029	181	0,07
120 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	122	0,05	200 Warnermedia Holdings Inc, 4,279 %, fällig 15.03.2032	180	0,07
160 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	124	0,05	50 Warnermedia Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	41	0,02
240 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	249	0,10	10 Warnermedia Holdings Inc, 5,141 %, fällig 15.03.2052	8	–
100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	78	0,03	150 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	150	0,06
60 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	42	0,02	260 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	234	0,09
260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	192	0,08	170 Wells Fargo & Co, 5,557 %, fällig 25.07.2034 *	174	0,07
10 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	10	–	1.020 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	943	0,38
230 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	240	0,10	130 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Ewige Anleihe *	130	0,05
190 ONEOK Inc, 6,050 %, fällig 01.09.2033	199	0,08	680 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, fällig 01.02.2030	648	0,26
50 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	49	0,02	10 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	9	–
370 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	369	0,15	170 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	190	0,08
160 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	143	0,06	200 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15.06.2031	227	0,09
270 Oracle Corp, 5,375 %, fällig 27.09.2054	253	0,10	718 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	861	0,35
310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	290	0,12	70 Williams Cos Inc/The, 5,150 %, fällig 15.03.2034	70	0,03
120 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	103	0,04	20 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	21	0,01
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	21	0,01		64.105	25,77
90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	88	0,04	Sambia – 0,28 % (29. Februar 2024: 0,08 %)		
230 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	210	0,08	680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	686	0,28
90 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	78	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 88.015 \$)		
20 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	17	0,01		82.214	33,05
120 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	123	0,05	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 9,87 % (29. Februar 2024: 10,98 %)		
830 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	695	0,28	Argentinien – 0,32 % (29. Februar 2024: 0,29 %)		
330 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	315	0,13	610 Internationale Staatsanleihe der Republik Argentinien, 3,500 %, fällig 09.07.2041	361	0,15
380 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	390	0,16	641 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,625 %, fällig 01.09.2037	425	0,17
30 Shell Finance US Inc, 4,550 %, fällig 12.08.2043	27	0,01		786	0,32
90 Shell Finance US Inc, 4,000 %, fällig 10.05.2046	73	0,03			
170 Shell Finance US Inc, 3,250 %, fällig 06.04.2050	119	0,05			
180 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	184	0,07			
740 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	758	0,31			
610 Solventum Corp, 5,600 %, fällig 23.03.2034	625	0,25			
10 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	10	–			
180 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	207	0,08			
552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 t.e.	480	0,19			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)											
Brasilien – 1,14 % (29. Februar 2024: 0,75 %)											
BRL	6.835	Brasilien, Letras do Tesouro Nacional, Series LTN, Nullkupon, fällig 01.01.2026	1.034	0,42	196	Citadel Securities LP, 6,329 %, fällig 24.10.2031 *	197	0,08			
BRL	9.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.417	0,57	343	Cloudera Inc, 8,162 %, fällig 10.08.2028 *	342	0,14			
BRL	1.599	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	211	0,08	195	DCert Buyer, Inc., 8,312 %, fällig 16.10.2026 *	189	0,08			
	240	Internationale Staatsanleihe Brasilien, 4,750 %, fällig 14.01.2050	171	0,07	229	First Eagle Holdings Inc, 7,329 %, fällig 22.02.2029 *	229	0,09			
			2.833	1,14	258	PCI Gaming Authority, 6,312 %, fällig 06.06.2031 *	258	0,10			
					379	Phoenix Guarantor Inc, 6,812 %, fällig 21.02.2031 *	378	0,15			
					Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 4.173 \$)		4.174	1,68			
Kolumbien – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,22 %)											
	290	Kolumbien, Internationale Staatsanleihe, 3,250 %, fällig 22.04.2032	229	0,09	Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,04 %)						
	500	Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 4,125 %, fällig 22.02.2042	327	0,13	Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,04 %)						
			556	0,22	2.840 Credit Suisse Group AG Escrow †			–	–		
Dominikanische Republik – 0,17 % (29. Februar 2024: 0,00 %)								Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)		–	
	420	Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 144A, 6,600 %, fällig 01.06.2036	424	0,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 254.286 \$)				238.446	95,85	
Israel – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,10 %)								Kontrakte (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD % vom Nettoinventarwert	
	450	Israel, Internationale Staatsanleihe, Series 10Y, 2,750 %, fällig 03.07.2030	399	0,16	Gekaufte Optionen – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,06 %)						
Kenia – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,16 %)								– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,0625, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley		47	0,02
	720	Republik Kenia, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,300 %, fällig 23.01.2034	585	0,23			– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,3125, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	104	0,04		
Mexiko – 0,34 % (29. Februar 2024: 4,04 %)								– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,00, fällig 13.06.2025 – Morgan Stanley		23	0,01
	1.140	Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 4,600 %, fällig 10.02.2048	854	0,34			– CME 3 Month SOFR Futures September 2025 Call 96,1250, fällig 12.09.2025 – Morgan Stanley	45	0,02		
Nigeria – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,04 %)								– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley		28	0,01
	300	Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027	294	0,12			– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	97	0,04		
Peru – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,11 %)								– U.S. 10 Year April 2025 Put 108,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley		2	–
	400	Peru, Internationale Staatsanleihe, 2,780 %, fällig 01.12.2060	223	0,09			– U.S. 10 Year Mai 2025 Put 107,50, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	6	–		
USA – 7,08 % (29. Februar 2024: 5,22 %)								– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 111,00, fällig 07.03.2025 Morgan Stanley		54	0,02
	1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig 15.11.2030	1.622	0,65			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,00, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	9	–		
	3.920	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034	3.981	1,60			– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	20	0,01		
	960	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.11.2025	965	0,39			– U.S. 5 Year Mai 2025 Call 106,50, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	112	0,05		
	10	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.08.2026	10	–			1.390 USD Call/CNH Put 7.2880, fällig 30.04.2025 – BNP Paribas	4	–		
	140	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2029	141	0,06			Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 364 \$)	551	0,22		
	10	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.11.2029	10	–			Credit Default Swaps – 0,20 % (29. Februar 2024: 0,39 %)				
	100	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.12.2029	102	0,04			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	504	0,20		
	2.060	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	2.005	0,81			Index-Swaps – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,88 %)				
	310	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	302	0,12			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	128	0,05		
	670	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.11.2034	673	0,27			Devisenterminkontrakte – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,05 %)				
	90	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.11.2044	91	0,04			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	232	0,09		
	1.260	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	775	0,31			Futures – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,19 %)				
	2.970	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	1.541	0,62			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.256	0,50		
	1.270	United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	704	0,28			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	241.117	96,91		
	300	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	177	0,07			Verkaufte Optionen – -0,13 % (29. Februar 2024: -0,03 %)				
	370	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	246	0,10			– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,5625, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	-54	-0,02		
	2.910	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	1.764	0,71			– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,50, fällig 13.06.2025 – Morgan Stanley	-19	-0,01		
	620	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	633	0,26			– U.S. 10 Year April 2025 Call 109,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-44	-0,02		
	1.120	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	1.077	0,43			– U.S. 10 Year April 2025 Call 111,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-46	-0,02		
	790	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.11.2054	792	0,32			– U.S. 10 Year April 2025 Put 106,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–		
			17.611	7,08			– U.S. 10 Year April 2025 Put 107,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 28.850 \$)				24.565	9,87			– U.S. 10 Year Juni 2025 Call 112,50, fällig 23.05.2025 – Morgan Stanley	-1	–	
Schuldscheindarlehen – 1,68 % (29. Februar 2024: 2,78 %)								– U.S. 10 Year Mai 2025 Put 106,00, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	-69	-0,03	
	476	Ali Group S.R.L., 6,426 %, fällig 13.10.2028 *	479	0,19			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 110,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	-5	–		
	383	API Group De Inc., 6,064 %, fällig 03.01.2029 *	383	0,16			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 109,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	-44	-0,02		
	380	Asurion LLC, 8,562 %, fällig 13.09.2030 *	378	0,15			– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	-2	–		
	282	Asurion LLC, 8,662 %, fällig 19.08.2028 *	282	0,11			– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-11	–		
	736	Brown Group Holding LLC, 6,812 %, fällig 01.07.2031 *	736	0,30			– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-6	–		
	248	Caesars Entertainment Inc, 6,562 %, fällig 06.02.2031 *	249	0,10			– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-23	-0,01		
	74	Caesars Entertainment Inc, 6,562 %, fällig 06.02.2030 *	74	0,03			– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Verkaufte Optionen – (Fortsetzung)		
– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-1	–
– U.S. Bond April 2025 Put 109,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-1	–
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -280 \$)	-337	-0,13
Credit Default Swaps – -0,08 % (29. Februar 2024: -0,05 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-201	-0,08
Index-Swaps – -0,20 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-505	-0,20
Devisenterminkontrakte – -0,12 % (29. Februar 2024: -0,17 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-296	-0,12
Futures – -0,25 % (29. Februar 2024: -0,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-634	-0,25
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.973	-0,78
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	239.144	96,13
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	9.629	3,87
Gesamtnettovermögen	248.773 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 47.217.000 \$ und machten 18,99 % des Nettovermögens aus.

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5.000 % – Kauf	20. Dez. 2029	2.717	\$ -201
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1.000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	23.333	504
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 3.206 \$)				\$ 504
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -459 \$)				-201
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 2.747 \$)				\$ 303

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 4,060 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	30. Nov. 2031	20.928	\$ -386
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 4,220 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	17. Jan. 2036	3.393	-119
Morgan Stanley	Zahlt variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound, erhält festen Zinssatz von 4,100 %	17. Jan. 2028	14.422	128
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 7.135 \$)				\$ 128
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -146 \$)				-505
Nettowertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 6.989 \$)				\$ -377

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2025	Citi	Kauf USD 1.254	Verkauf BRL 7.290	\$ 17
6. März 2025	Citi	Kauf USD 1.141	Verkauf BRL 6.770	-7
6. März 2025	Citi	Kauf BRL 17.260	Verkauf USD 3.000	-72
6. März 2025	Goldman Sachs	Kauf USD 345	Verkauf BRL 2.000	6
6. März 2025	Goldman Sachs	Kauf USD 202	Verkauf BRL 1.200	-2
14. März 2025	BNY	Kauf USD 90	Verkauf AUD 143	1
14. März 2025	BNY	Kauf USD 6	Verkauf EUR 6	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 1	Verkauf EUR 1	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 8	Verkauf USD 8	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 9	Verkauf USD 11	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 494	Verkauf USD 509	2
14. März 2025	BNY	Kauf AUD 316	Verkauf USD 199	-3
02. Apr. 2025	Citi	Kauf USD 2.802	Verkauf BRL 16.200	71
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 293	Verkauf EUR 280	2
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf AUD 3.296	Verkauf USD 2.041	5

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	EUR 480	Verkauf	USD 502	\$ -2	
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	CAD 356	Verkauf	USD 249	-2	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 1.482	Verkauf	GBP 1.203	-30	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	CAD 258	Verkauf	USD 180	-1	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	EUR 250	Verkauf	USD 261	-1	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1	Verkauf	CHF 1	–	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.597	Verkauf	INR 139.500	8	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.344	Verkauf	JPY 204.820	-25	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 702	Verkauf	JPY 103.980	7	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	JPY 354.313	Verkauf	USD 2.275	92	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	INR 70.896	Verkauf	USD 817	-9	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	MXN 15.790	Verkauf	USD 761	2	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	MXN 78.090	Verkauf	USD 3.807	-33	
16. Apr. 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR 240	Verkauf	USD 251	-1	
16. Apr. 2025	Goldman Sachs	Kauf	MXN 39.052	Verkauf	USD 1.894	-7	
16. Apr. 2025	Goldman Sachs	Kauf	MXN 8.570	Verkauf	USD 414	1	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 6.340	Verkauf	CNH 46.535	-56	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 251	Verkauf	INR 22.070	-1	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 653	Verkauf	INR 56.980	4	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	CNH 4.380	Verkauf	USD 601	1	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	CNH 19.620	Verkauf	USD 2.715	-19	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 2.922	Verkauf	EUR 2.825	-15	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 6.940	Verkauf	MXN 143.326	13	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	EUR 590	Verkauf	USD 620	-7	
06. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf	CNH 3.210	Verkauf	USD 445	-3	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 416 \$)						\$	232
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1,408 \$)							-296
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -992 \$)						\$	-64

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	116	\$ 27.931	\$ -89
3 Month SOFR Index Dezember 2026	Morgan Stanley	30	7.233	21
3 Month SOFR Index September 2025	Morgan Stanley	-26	-6,251	-13
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2025	Morgan Stanley	-5	-4,642	86
Long Gilt Juni 2025	Morgan Stanley	21	2.468	5
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	-135	-14.998	-195
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Morgan Stanley	-115	-13.139	-314
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	-9	-1,863	-9
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	399	43.067	268
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	317	37.436	876
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	-4	-496	-14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1.495 \$)				\$ 1.256
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -552 \$)				-634
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 943 \$)				\$ 622

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 5,96 % (29. Februar 2024: 1,79 %)			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 40,94 % (29. Februar 2024: 45,46 %)		
650 AGL CLO 22 Ltd, Series 2022 22A, Class D1R, 144A, 6,993 %, fällig 20.01.2037 *	650	0,27	Belgien – 0,10 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
680 AGL CLO 35 Ltd, Series 2024 35A, Class D1, 144A, 7,362 %, fällig 21.01.2038 *	692	0,29	EUR 220 Azelis Finance NV, 4,750 %, fällig 25.09.2029	237	0,10
620 Apidos CLO L, Series 2024 50A, Class D1, 144A, 7,167 %, fällig 20.01.2038 *	638	0,26	Brasilien – 0,78 % (29. Februar 2024: 0,92 %)		
774 Arbys Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,237 %, fällig 30.07.2050	743	0,31	1.400 B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	1.256	0,52
600 CarVal CLO VII-C Ltd, Series 2023 1A, Class D1R, 144A, 7,443 %, fällig 20.07.2037 *	611	0,25	630 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	616	0,26
430 CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class D1, 144A, 7,571 %, fällig 20.10.2037 *	434	0,18		1.872	0,78
300 CBAM 2017-3 Ltd, Series 2017 3A, Class DR, 144A, 8,064 %, fällig 17.07.2034 *	300	0,13	Kanada – 0,54 % (29. Februar 2024: 0,52 %)		
610 Goldentree Loan Management US Clo 7 Ltd, Series 2020 7A, Class DRR, 144A, 7,093 %, fällig 20.04.2034 *	610	0,25	380 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	376	0,16
400 Hartwick Park CLO Ltd, Series 2023 1A, Class DR, 144A, 6,993 %, fällig 20.01.2037 *	400	0,17	260 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	246	0,10
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M5, 5,379 %, fällig 25.12.2035 *	566	0,23	740 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	684	0,28
600 HPS Loan Management 2024-22 Ltd, Series 2024 22A, Class D1, 144A, 7,300 %, fällig 20.10.2037 *	610	0,25		1.306	0,54
288 Jack in the Box Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,476 %, fällig 25.08.2049	284	0,12	China – 0,46 % (29. Februar 2024: 0,51 %)		
470 Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A2I, 144A, 3,445 %, fällig 26.02.2052	453	0,19	1.680 Prosus NV, 3,832 %, fällig 08.02.2051	1.116	0,46
580 LCM 39 Ltd 39A, Class DR, 144A, 7,552 %, fällig 15.10.2034 *	578	0,24	Kolumbien – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,24 %)		
550 LCM 40 Ltd 40A, Class D1R, 144A, 8,052 %, fällig 15.01.2038 *	557	0,23	550 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	577	0,24
830 Mosaic Solar Loan Trust 2023-4, Series 2023 4A, Class C, 144A, 8,800 %, fällig 20.05.2053	782	0,32	Dänemark – 0,34 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
830 Obra CLO 1 Ltd, Series 2024 1A, Class D1, 144A, 7,823 %, fällig 20.01.2038 *	852	0,35	820 Danske Bank A/S, 7,000 %, Ewige Anleihe *	821	0,34
650 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D1R, 144A, 7,393 %, fällig 20.01.2038 *	663	0,27	Dominikanische Republik – 0,18 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
770 Ocean Trails Clo XVI Ltd, Series 2024 16A, Class D1, 144A, 7,861 %, fällig 20.01.2038 *	795	0,33	430 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 7,000 %, fällig 30.06.2034	437	0,18
1.025 ServiceMaster Funding LLC, Series 2021 1, Class A2II, 144A, 3,113 %, fällig 30.07.2051	873	0,36	Finnland – 0,28 % (29. Februar 2024: 0,28 %)		
557 SMB Private Education Loan Trust 2021-B, Series 2021 B, Class A, 144A, 1,310 %, fällig 17.07.2051	517	0,22	EUR 650 Nordea Bank Abp, 3,500 %, Ewige Anleihe *	674	0,28
840 Symphony CLO 40 Ltd, Series 2023 40A, Class D1R, 144A, 7,070 %, fällig 05.01.2038 *	859	0,36	Frankreich – 2,75 % (29. Februar 2024: 3,06 %)		
510 Trinitas CLO XIX Ltd, Series 2022 19A, Class D1R, 144A, 7,243 %, fällig 20.10.2033 *	511	0,21	EUR 140 Affielou SAS, 6,000 %, fällig 25.07.2029	152	0,06
410 Valley Stream Park CLO Ltd, Series 2022 1A, Class DRR, 144A, 6,993 %, fällig 20.01.2037 *	409	0,17	530 Altice France SA, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	476	0,20
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 14.198 \$)	14.387	5,96	EUR 350 Banijay Entertainment SAS, 7,000 %, fällig 01.05.2029	383	0,16
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 3,79 % (29. Februar 2024: 3,90 %)			EUR 1.000 BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig 31.03.2032 *	1.022	0,42
650 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class D, 144A, 6,147 %, fällig 15.09.2034 *	635	0,26	EUR 1.690 BNP Paribas SA, 7,375 %, Ewige Anleihe *	1.701	0,71
580 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,663 %, fällig 15.11.2061 *	565	0,23	800 Credit Agricole SA, 5,875 %, Ewige Anleihe *	839	0,35
279 BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQMS, Series 2024 NQMS, Class A3, 144A, 6,158 %, fällig 25.06.2064	280	0,12	EUR 780 Goldstory SAS, 6,750 %, fällig 01.02.2030	852	0,35
470 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class D, 144A, 3,110 %, fällig 10.04.2048	378	0,16	EUR 150 IPD 3 BV, 8,000 %, fällig 15.06.2028	164	0,07
290 COMM 2018-COR3 Mortgage Trust, Series 2018 COR3, Class B, 4,516 %, fällig 10.05.2051 *	253	0,11	EUR 180 IPD 3 BV, 6,261 %, fällig 15.06.2031 *	189	0,08
191 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 8,566 %, fällig 25.07.2039 *	198	0,08	EUR 370 Kapa Holding SAS, 5,000 %, fällig 30.04.2031	394	0,16
260 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,716 %, fällig 25.01.2040 *	269	0,11	EUR 420 Rexel SA, 5,250 %, fällig 15.09.2030	458	0,19
450 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 7,452 %, fällig 25.10.2041 *	462	0,19		6.630	2,75
390 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 7,453 %, fällig 25.06.2043 *	411	0,17	Deutschland – 1,86 % (29. Februar 2024: 2,36 %)		
290 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R08, Series 2023 R08, Class 1M2, 144A, 6,852 %, fällig 25.10.2043 *	300	0,13	EUR 1.400 Allianz SE, 3,200 %, Ewige Anleihe *	1.243	0,52
410 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R02, Series 2024 R02, Class 1M2, 144A, 6,152 %, fällig 25.02.2044 *	415	0,17	EUR 600 CT Investment GmbH, 6,375 %, fällig 15.04.2030	650	0,27
800 CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,354 %, fällig 15.08.2048 *	697	0,29	EUR 489 Nidda Healthcare Holding GmbH, 7,500 %, fällig 21.08.2026	521	0,22
710 CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C7, Class C, 4,371 %, fällig 15.11.2049 *	654	0,27	EUR 460 Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, Series NOV, 5,375 %, fällig 15.07.2029	494	0,20
220 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 10,102 %, fällig 25.09.2042 *	243	0,10	EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	588	0,24
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05.11.2038 *	926	0,38	EUR 102 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	106	0,04
650 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C30, Series 2015 C30, Class AS, 4,226 %, fällig 15.07.2048 *	633	0,26	EUR 900 ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	895	0,37
794 Neighborly Issuer 2023-1, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,308 %, fällig 30.01.2053	817	0,34		4.497	1,86
470 OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig 25.11.2063	473	0,20	Guatemala – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,49 %)		
532 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	537	0,22	1.233 Millicom International Cellular SA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	1.195	0,50
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 9.038 \$)	9.146	3,79	Indonesien – 0,17 % (29. Februar 2024: 0,17 %)		
			460 Pertamina Persero PT, 3,100 %, fällig 27.08.2030	420	0,17
			Irland – 0,48 % (29. Februar 2024: 0,21 %)		
			590 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	525	0,22
			610 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6,950 %, fällig 10.03.2055 *	629	0,26
				1.154	0,48
			Israel – 0,79 % (29. Februar 2024: 0,77 %)		
			EUR 300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig 15.09.2029	359	0,15
			1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.210	0,50
			310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	348	0,14
				1.917	0,79
			Italien – 1,06 % (29. Februar 2024: 1,05 %)		
			EUR 1.010 Fibercop SpA, 2,375 %, fällig 12.10.2027	1.019	0,42
			GBP 770 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig 14.03.2029 *	1.004	0,42
			EUR 510 TeamSystem SpA, 6,285 %, fällig 31.07.2031 *	533	0,22
				2.556	1,06
			Kasachstan – 0,42 % (29. Februar 2024: 1,00 %)		
			460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	455	0,19
			660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	559	0,23
				1.014	0,42

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)										
Luxemburg – 0,32 % (29. Februar 2024: 0,63 %)										
EUR	120	AccorInvest Group SA, 6,375 %, fällig 15.10.2029	132	0,06	GBP	810	Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15.07.2031	881	0,37	
GBP	530	Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	634	0,26	GBP	1.020	Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086 *	1.397	0,58	
			766	0,32	GBP	1.000	Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	1.188	0,49	
					GBP	620	Whitbread Group Plc, 5,500 %, fällig 31.05.2032	778	0,32	
						19.466		8,07		
Mexiko – 0,93 % (29. Februar 2024: 1,48 %)				USA – 14,29 % (29. Februar 2024: 17,67 %)						
	1.250	Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Ewige Anleihe *	1.240	0,51	EUR	930	Air Lease Corp, 3,700 %, fällig 15.04.2030	984	0,41	
	1.060	BBVA Mexico SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero BBVA Mexico/TX, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	1.014	0,42		92	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	92	0,04	
			2.254	0,93	1.320	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	1.314	0,54		
Niederlande – 2,09 % (29. Februar 2024: 2,04 %)					660	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	605	0,25		
EUR	420	Boels Topholding BV, 5,750 %, fällig 15.05.2030	457	0,19	200	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029	175	0,07		
GBP	450	Boost Newco Borrower LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8,500 %, fällig 15.01.2031	607	0,25	1.310	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	670	0,28		
EUR	200	Coöperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	207	0,08	570	Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	569	0,24		
EUR	800	Coöperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Ewige Anleihe *	812	0,34	280	Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 *	282	0,12		
GBP	1.100	ING Groep NV, 5,000 %, fällig 30.08.2026 *	1.385	0,57	850	Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042 *	656	0,27		
	1.110	Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig 15.08.2026	1.103	0,46	140	Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	113	0,05		
	550	VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	485	0,20	840	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2032	852	0,35		
			5.056	2,09	320	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	277	0,11		
Peru – 0,17 % (29. Februar 2024: 0,17 %)					400	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	359	0,15		
	610	Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	402	0,17	1.380	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	975	0,40		
Polen – 0,26 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					250	Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	235	0,10		
EUR	600	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 3,375 %, fällig 16.06.2028 *	628	0,26	730	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	915	0,38		
Slowenien – 0,31 % (29. Februar 2024: 0,31 %)					1.548	Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	1.289	0,53		
EUR	710	United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	739	0,31	750	CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	627	0,26		
Südafrika – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,08 %)					680	DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	717	0,30		
	200	Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	200	0,08	624	Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	625	0,26		
Spanien – 1,69 % (29. Februar 2024: 1,70 %)					246	Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	247	0,10		
EUR	1.000	Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	1.111	0,46	1.000	Devon Energy Corp, 5,200 %, fällig 15.09.2034	972	0,40		
EUR	800	CaixaBank SA, 4,000 %, fällig 05.03.2037 *	830	0,34	1.000	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	893	0,37		
EUR	1.300	Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.02.2033	1.211	0,50	670	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	596	0,25		
EUR	600	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	625	0,26	630	Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	631	0,26		
EUR	300	Telefonica Europe BV, 3,875 %, Ewige Anleihe *	313	0,13	710	Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	674	0,28		
			4.090	1,69	390	Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, fällig 02.11.2027	373	0,15		
Supranational – 0,86 % (29. Februar 2024: 0,91 %)					1.515	Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	1.366	0,57		
INR	90.200	European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig 26.10.2027	1.021	0,42	1.130	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.078	0,45		
INR	93.900	International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig 13.07.2029	1.055	0,44	235	Goldman Sachs Capital II, 5,348 %, Ewige Anleihe *	203	0,08		
			2.076	0,86	590	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 29.10.2029 *	711	0,29		
Schweden – 0,33 % (29. Februar 2024: 0,67 %)					1.000	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	1.001	0,41		
EUR	750	Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	805	0,33	330	JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	235	0,10		
Schweiz – 0,59 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					260	Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	256	0,11		
EUR	870	Dufry One BV, 4,750 %, fällig 18.04.2031	939	0,39	930	Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	878	0,36		
	480	UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	482	0,20	690	Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	641	0,27		
			1.421	0,59	1.450	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	1.385	0,57		
Vereinigtes Königreich – 8,07 % (29. Februar 2024: 7,96 %)					320	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	327	0,14		
GBP	530	B&M European Value Retail SA, 4,000 %, fällig 15.11.2028	629	0,26	205	Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	236	0,10		
GBP	180	B&M European Value Retail SA, 8,125 %, fällig 15.11.2030	241	0,10	700	Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 +e	609	0,25		
	200	Barclays Plc, 7,625 %, Ewige Anleihe *	201	0,08	640	Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	648	0,27		
GBP	620	Barclays Plc, 7,125 %, Ewige Anleihe *	782	0,32	450	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	431	0,18		
GBP	1.160	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	1.436	0,60	1.130	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.090	0,45		
GBP	1.299	Greene King Finance Plc, Series B2, 6,839 %, fällig 15.03.2036 *	1.390	0,58	790	United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	791	0,33		
	400	HSBC Holdings Plc, 4,762 %, fällig 29.03.2033 *	383	0,16	1.000	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	915	0,38		
	1.240	HSBC Holdings Plc, 6,375 %, Ewige Anleihe *	1.240	0,51	530	Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	526	0,22		
EUR	330	INEOS Quattro Finance 2 Plc, 6,750 %, fällig 15.04.2030	354	0,15	1.000	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	982	0,41		
GBP	1.340	Lloyds Banking Group Plc, 8,500 %, Ewige Anleihe *	1.761	0,73	510	Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	623	0,26		
GBP	1.275	Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,228 %, fällig 16.07.2035 *	1.384	0,57	730	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	675	0,28		
	660	NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029 *	799	0,33	880	Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Ewige Anleihe *	881	0,36		
GBP	170	NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	222	0,09	210	Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	209	0,09		
EUR	520	PEU Fin Plc, 7,250 %, fällig 01.07.2028	565	0,23	480	Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	431	0,18		
GBP	730	Pinewood Finco Plc, 6,000 %, fällig 27.03.2030	920	0,38	720	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	636	0,26		
GBP	400	Pinnacle Bidco Plc, 10,000 %, fällig 11.10.2028	538	0,22			34.481	14,29		
GBP	550	Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2026	687	0,29	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 102.860 \$)				98.807	40,94
EUR	430	RAY Financing LLC, 6,500 %, fällig 15.07.2031	472	0,20						
GBP	439	Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, fällig 13.10.2041	545	0,23						
GBP	555	Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	673	0,28						

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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 – 37,66 % (29. Februar 2024: 37,64 %)							
Argentinien – 0,38 % (29. Februar 2024: 0,53 %)							
1.372	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	911	0,38	6.850	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	5.402	2,24
Brasilien – 0,70 % (29. Februar 2024: 1,23 %)				820	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	629	0,26
BRL	10.694 Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.684	0,70	430	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	321	0,13
Kolumbien – 0,43 % (29. Februar 2024: 0,44 %)				40	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	20	0,01
1.350	Kolumbien, Internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 26.02.2044	1.031	0,43	200	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	104	0,04
Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,28 % (29. Februar 2024: 0,36 %)				270	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	205	0,09
EUR	680 Elfenbeinküste, internationale Staatsanleihe, 5,250 %, fällig 22.03.2030	679	0,28	410	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	352	0,15
Dominikanische Republik – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,50 %)						62.125	25,74
1.360	Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 144A, 4,875 %, fällig 23.09.2032	1.246	0,52	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 97.392 \$)			
Ägypten – 0,30 % (29. Februar 2024: 0,96 %)						90.869	37,66
EUR	780 Ägypten, Internationale Staatsanleihe, 6,375 %, fällig 11.04.2031	724	0,30	Schuldscheindarlehen – 1,51 % (29. Februar 2024: 2,09 %)			
Deutschland – 1,96 % (29. Februar 2024: 0,62 %)				573	Alterra Mountain Co, 7,062 %, fällig 17.08.2028 *	575	0,24
EUR	4.610 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	4.731	1,96	545	API Group De Inc., 6,064 %, fällig 03.01.2029 *	545	0,23
Indonesien – 0,99 % (29. Februar 2024: 1,05 %)				664	Asurion LLC, 8,662 %, fällig 19.08.2028 *	664	0,27
IDR	39.219.000 Indonesien, Schatzanleihe, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	2.391	0,99	265	Fugue Finance LLC, 8,285 %, fällig 26.01.2028 *	267	0,11
Israel – 0,49 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				295	Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,462 %, fällig 15.11.2027 *	293	0,12
1.160	Israel, Internationale Staatsanleihe, Series 5Y, 5,375 %, fällig 19.02.2030	1.170	0,49	120	Nexstar Broadcasting Inc, 6,926 %, fällig 19.09.2026 *	120	0,05
Kenia – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,25 %)				915	Sedgwick Claims Management, 7,312 %, fällig 30.06.2031 *	916	0,38
590	Republik Kenia, Internationale Staatsanleihe, 9,750 %, fällig 16.02.2031	597	0,25	271	Spirit Airlines, 11,322 %, fällig 18.11.2025 **	271	0,11
Mexiko – 1,93 % (29. Februar 2024: 3,43 %)						3.651	1,51
MXN	32.700 Mexikanische Bonos, Series M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	1.552	0,64	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 3.632 \$)			
MXN	77.947 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	3.105	1,29				
		4.657	1,93	Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,33 % (29. Februar 2024: 1,30 %)			
Nigeria – 0,46 % (29. Februar 2024: 0,45 %)				22	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	3.211	1,33
1.400	Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 7,625 %, fällig 28.11.2047	1.121	0,46				
Polen – 1,65 % (29. Februar 2024: 1,74 %)				Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.474 \$)			
PLN	20.700 Staatsanleihe der Republik Polen, Series 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	3.983	1,65			3.211	1,33
Südafrika – 1,58 % (29. Februar 2024: 1,51 %)				Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,22 %)			
ZAR	84.478 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	2.957	1,22	Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,09 %)			
1.130	Republik Südafrika, Staatsanleihe, 5,750 %, fällig 30.09.2049	862	0,36	1.760	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	–	–
		3.819	1,58			–	–
USA – 25,74 % (29. Februar 2024: 24,25 %)				Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)			
7.910	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	7.650	3,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 229.594 \$)			
2.250	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.03.2027	2.101	0,87			220.071	91,19
10.390	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	10.430	4,32	Devisenterminkontrakte – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,15 %)			
500	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	495	0,21			613	0,25
24.090	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	24.660	10,22	Futures – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,02 %)			
2.000	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.09.2030	2.057	0,85			62	0,03
1.500	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	1.500	0,62	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
120	United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	82	0,03			220.746	91,47
140	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2041	99	0,04	Devisenterminkontrakte – -0,44 % (29. Februar 2024: -0,65 %)			
600	United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.08.2042	519	0,22			-1.070	-0,44
2.320	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	2.182	0,90	Futures – -0,22 % (29. Februar 2024: -0,06 %)			
1.696	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	1.667	0,69			-532	-0,22
1.650	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.05.2045	1.309	0,54	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
500	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2046	341	0,14			-1.602	-0,66
				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
						219.144	90,81
				Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
						22.179	9,19
				Gesamt Nettovermögen			
						241.323 \$	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

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

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2025	Citi	Kauf	USD 2.359	Verkauf	INR 204.777	\$ 20
13. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 3.065	Verkauf	TWD 99.169	40
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 98	Verkauf	EUR 94	1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 15	Verkauf	EUR 15	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 6	Verkauf	GBP 5	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 20	Verkauf	GBP 16	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD –	Verkauf	SGD –	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 14	Verkauf	USD 15	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 3.682	Verkauf	USD 3.804	17
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 4	Verkauf	USD 5	–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 716	Verkauf	USD 886	15
14. März 2025	BNY	Kauf	PLN 10.171	Verkauf	USD 2.508	6
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 10	Verkauf	USD 8	–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 958	Verkauf	USD 708	1
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD 70.174	Verkauf	USD 44.111	-565
14. März 2025	BNY	Kauf	ZAR 505.031	Verkauf	USD 27.363	-398
14. März 2025	BNY	Kauf	PLN 113	Verkauf	USD 29	-1
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF 53.673	Verkauf	USD 59.161	366
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 1.730	Verkauf	ZAR 31.941	23
17. März 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD 520	Verkauf	TRY 19.390	-4
17. März 2025	Goldman Sachs	Kauf	TRY 19.390	Verkauf	USD 507	17
13. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 1.868	Verkauf	PLN 7.583	-1
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 29.726	Verkauf	EUR 28.496	50
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 22.393	Verkauf	GBP 17.875	-89
13. Mai 2025	Citi	Kauf	EUR 665	Verkauf	USD 700	-7
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR 323	Verkauf	USD 338	-2
13. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	USD 3.096	Verkauf	MXN 64.206	5
13. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	AUD 3.230	Verkauf	USD 2.007	-1
13. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 1.495	Verkauf	ZAR 28.186	-2
13. Mai 2025	Royal Bank of Canada	Kauf	JPY 603.852	Verkauf	USD 4.000	46
13. Mai 2025	UBS	Kauf	USD 2.397	Verkauf	CNH 17.373	6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 364 \$)						\$ 613
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1,576 \$)						-1,070
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1,212 \$)						\$ -457

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund März 2025	Bank of America Merrill Lynch	58	\$ 8.014	\$ -220
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-1	-135	12
Long Gilt Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	35	4.113	38
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-5	-555	-8
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-27	-3,085	-74
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	12	2.484	12
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-60	-7,086	-119
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-30	-3,724	-111
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 43 \$)				\$ 62
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -139 \$)				-532
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -96 \$)				\$ -470

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 5,16 % (29. Februar 2024: 5,29 %)			Italien – 1,26 % (29. Februar 2024: 1,81 %)		
110 1988 CLO 5 Ltd, Series 2024 5A, Class D1, 144A, 7,602 %, fällig 15.07.2037 *	112	0,13	413 Fiberco SpA, 144A, 6,000 %, fällig 30.09.2034	391	0,45
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 7,655 %, fällig 20.10.2031 *	503	0,58	700 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	703	0,81
250 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 7,914 %, fällig 15.04.2034 *	251	0,29		1.094	1,26
310 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144A, 11,055 %, fällig 20.07.2034 *	312	0,36	Japan – 0,41 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
100 AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 7,203 %, fällig 17.07.2037 *	101	0,12	370 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,810 %, fällig 17.09.2030	356	0,41
160 Bain Capital Credit CLO 2019-1, Series 2019 1A, Class DR2, 144A, 7,393 %, fällig 19.04.2034 *	161	0,18	Luxemburg – 0,55 % (29. Februar 2024: 1,04 %)		
230 Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class DRR, 144A, 7,390 %, fällig 23.10.2034 *	231	0,26	300 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	236	0,27
250 Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,693 %, fällig 20.07.2037 *	255	0,29	710 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	222	0,26
300 GoldenTree Loan Management US CLO 16 Ltd, Series 2022 16A, Class DRR, 144A, 6,716 %, fällig 20.01.2038 *	301	0,35	269 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	19	0,02
200 Golub Capital Partners CLO 60B Ltd, Series 2022 60A, Class ER, 144A, 10,300 %, fällig 25.10.2034 *	201	0,23		477	0,55
150 Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 7,500 %, fällig 25.07.2037 *	153	0,18	Macau – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,69 %)		
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 9,514 %, fällig 15.04.2031 *	251	0,29	350 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	340	0,39
150 HPS Loan Management 2024-20 Ltd, Series 2024 20A, Class D2, 144A, 8,800 %, fällig 25.07.2037 *	153	0,18	Niederlande – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,42 %)		
443 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,244 %, fällig 15.10.2031 *	445	0,51	200 Sunrise HoldCo IV BV, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	197	0,23
220 Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 1A, Class DR, 144A, 7,893 %, fällig 26.08.2034 *	222	0,25	Spanien – 0,53 % (29. Februar 2024: 0,44 %)		
300 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 8,001 %, fällig 13.10.2031 *	302	0,35	400 Banco Santander SA, 9,625 %, Ewige Anleihe *	464	0,53
130 OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D1, 144A, 7,193 %, fällig 20.07.2037 *	132	0,15	Schweiz – 1,45 % (29. Februar 2024: 1,45 %)		
220 PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 0,000 %, fällig 20.04.2038 *	221	0,25	220 UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	233	0,27
180 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,690 %, fällig 23.07.2037 *	182	0,21	230 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	252	0,29
			260 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	261	0,30
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.405 \$)	4.489	5,16	100 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2027	99	0,11
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 88,49 % (29. Februar 2024: 85,85 %)			60 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.06.2028	60	0,07
Kanada – 2,66 % (29. Februar 2024: 3,12 %)			390 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2030	352	0,41
250 Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig 27.01.2084 *	261	0,30		1.257	1,45
470 Bombardier Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.11.2030	504	0,58	Vereinigte Arabische Emirate – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,38 %)		
280 Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	287	0,33	380 Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, fällig 15.04.2029	337	0,39
90 Bombardier Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.06.2032	91	0,11	Vereinigtes Königreich – 2,75 % (29. Februar 2024: 3,49 %)		
230 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028	226	0,26	210 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	193	0,22
320 Empire Communities Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.05.2029	334	0,38	200 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 15.08.2029	210	0,24
230 Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2028	236	0,27	530 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, fällig 15.01.2032	491	0,57
200 Toronto-Dominion Bank/The, 7,250 %, fällig 31.07.2084 *	203	0,23	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	720	0,83
180 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	175	0,20	740 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	777	0,89
	2.317	2,66		2.391	2,75
Frankreich – 3,01 % (29. Februar 2024: 2,65 %)			USA – 69,11 % (29. Februar 2024: 65,40 %)		
240 Altice France SA, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	193	0,22	120 Adient Global Holdings Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2033	120	0,14
670 Altice France SA, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029	521	0,60	200 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	199	0,23
210 BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Ewige Anleihe *	222	0,26	510 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030	517	0,59
810 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	843	0,97	500 Akumin Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.08.2027	430	0,49
820 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	838	0,96	1.130 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	446	0,51
	2.617	3,01	240 Alpha Generation LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2032	244	0,28
Deutschland – 0,73 % (29. Februar 2024: 0,70 %)			190 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2029	161	0,18
70 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	74	0,08	180 AMC Networks Inc, 144A, 10,250 %, fällig 15.01.2029	191	0,22
250 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	250	0,29	760 American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	801	0,92
320 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	309	0,36	390 American Airlines Inc/Aadvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	388	0,45
	633	0,73	490 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	449	0,52
Hongkong – 0,59 % (29. Februar 2024: 0,23 %)			95 Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.08.2026	1	–
250 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	233	0,27	520 APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	523	0,60
280 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 7,625 %, fällig 17.04.2032	281	0,32	390 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029	363	0,42
	514	0,59	250 Arcosa Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.08.2032	256	0,29
Indien – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,34 %)			130 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	126	0,15
340 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig 31.10.2026	337	0,39	110 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	106	0,12
Israel – 1,54 % (29. Februar 2024: 1,23 %)			690 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	498	0,57
540 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	547	0,63	400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030	259	0,30
710 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	797	0,91	100 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.08.2030	103	0,12
	1.344	1,54	30 Bloom Energy Corp, 144A, 3,000 %, fällig 01.06.2029	42	0,05
			430 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.07.2032	450	0,52
			370 Boost Newco Borrower LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	387	0,45
			50 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.02.2032	51	0,06
			550 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	593	0,68

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
240 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	247	0,28	30 GFL Environmental Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2031	31	0,04
200 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.10.2032	195	0,22	510 Gray Media Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2031	297	0,34
220 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.03.2030	221	0,25	207 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	223	0,26
230 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	232	0,27	100 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig 01.11.2033	105	0,12
480 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	449	0,52	460 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.07.2032	480	0,55
1.040 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	935	1,08	130 iHeartCommunications Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.05.2029	111	0,13
90 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	79	0,09	184 iHeartCommunications Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2031	137	0,16
530 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	459	0,53	230 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig 25.05.2026	227	0,26
250 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	210	0,24	550 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	571	0,66
390 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	350	0,40	130 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	131	0,15
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, fällig 01.04.2051	168	0,19	220 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	230	0,26
120 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	84	0,10	130 JPMorgan Chase & Co, Series OO, 6,500 %, Ewige Anleihe *	133	0,15
860 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	730	0,84	50 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	48	0,06
560 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	574	0,66	410 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2031	426	0,49
270 Citigroup Inc, Series BB, 7,200 %, Ewige Anleihe *	280	0,32	440 Level 3 Financing Inc, 144A, 11,000 %, fällig 15.11.2029	500	0,57
150 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2030	154	0,18	130 Life Time Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2031	131	0,15
455 Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2031	462	0,53	440 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	470	0,54
370 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2029	328	0,38	200 LifePoint Health Inc, 144A, 11,000 %, fällig 15.10.2030	220	0,25
340 Cloud Software Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 30.09.2029	348	0,40	220 Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	229	0,26
320 Cloud Software Group Inc, 144A, 8,250 %, fällig 30.06.2032	332	0,38	270 LSF11 AS HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	278	0,32
600 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	521	0,60	30 Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028	29	0,03
532 CommScope LLC, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	479	0,55	470 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig 30.06.2029	454	0,52
130 CommScope LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.12.2031	135	0,16	460 Masterbrand Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2032	469	0,54
160 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.02.2028	168	0,19	1.413 McClatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031	1.447	1,66
270 CSC Holdings LLC, 144A, 11,250 %, fällig 15.05.2028	263	0,30	550 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	534	0,61
810 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	677	0,78	180 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	183	0,21
320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	184	0,21	590 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	443	0,51
250 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	184	0,21	420 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, fällig 15.01.2030	396	0,45
200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	142	0,16	300 Miter Brands Acquisition Holdco Inc / MIWD Borrower LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.04.2032	306	0,35
230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	118	0,14	170 MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2030	163	0,19
200 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	215	0,25	300 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	206	0,24
130 Diebold Nixdorf Inc, 144A, 7,750 %, fällig 31.03.2030	136	0,16	110 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	113	0,13
30 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	30	0,03	520 NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 15.01.2029	552	0,63
180 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	177	0,20	650 NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	692	0,80
840 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	750	0,86	320 NCR Atleos Corp, 144A, 9,500 %, fällig 01.04.2029	350	0,40
630 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	560	0,64	315 New Generation Gas Gathering LLC, 144A, 10,052 %, fällig 30.09.2029 **∞	310	0,36
130 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	88	0,10	160 Newell Brands Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2030	160	0,18
70 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	70	0,08	370 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	376	0,43
170 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15.02.2028	152	0,17	760 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ^{see}	–	–
170 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	136	0,16	240 NRG Energy Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.11.2034	241	0,28
270 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	241	0,28	170 Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	174	0,20
220 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	231	0,27	176 Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, fällig 15.07.2031	194	0,22
900 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	965	1,11	210 Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2032	216	0,25
360 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	340	0,39	250 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	242	0,28
440 Endo Finance Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.04.2031 †	472	0,54	840 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	819	0,94
440 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	466	0,54	500 Primo Water Holdings Inc / Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	499	0,57
210 Esab Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2029	214	0,25	400 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	406	0,47
490 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	465	0,53	335 Rackspace Finance LLC, 144A, 3,500 %, fällig 15.05.2028	185	0,21
260 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.01.2029	246	0,28	230 Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	234	0,27
250 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	246	0,28	310 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	319	0,37
120 FirstCash Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2032	123	0,14	830 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	718	0,83
481 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, fällig 15.01.2028	492	0,57	920 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	931	1,07
500 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	430	0,49	200 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	205	0,24
500 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	455	0,52	430 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 10,875 %, fällig 01.08.2029	442	0,51
480 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	484	0,56	510 Ryan Specialty LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2032	507	0,58
220 Garrett Motion Holdings Inc / Garrett LX I Srl, 144A, 7,750 %, fällig 31.05.2032	224	0,26	230 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	213	0,24
160 Gates Corp/DE, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2029	164	0,19	520 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2032	528	0,61
340 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	351	0,40	300 Service Properties Trust, 8,375 %, fällig 15.06.2029	304	0,35
130 Gen Digital Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2033	130	0,15	170 Service Properties Trust, 144A, 8,625 %, fällig 15.11.2031	182	0,21
190 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	183	0,21			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 293 \$)		
USA – (Fortsetzung)			Schuldscheindarlehen – 6,09 % (29. Februar 2024: 6,41 %)		
640 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	653	0,75	164 Aftalem Global Education, 7,062 %, fällig 14.08.2028 *	164	0,19
340 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029	317	0,36	460 Asurion LLC, 8,412 %, fällig 17.08.2028 *	460	0,53
330 Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 28.11.2025	331	0,38	249 Clarios Global LP, 6,812 %, fällig 06.05.2030 *	249	0,29
260 Snap Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2033	263	0,30	189 Cotiviti Inc, 7,059 %, fällig 30.04.2031 *	187	0,21
430 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	443	0,51	400 DCert Buyer, Inc., 11,312 %, fällig 16.02.2029 *	327	0,38
70 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2027	68	0,08	190 Deerfield Dakota Holding LLC, 11,340 %, fällig 14.04.2028 *	185	0,21
380 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 t±	331	0,38	262 Eyecare Tranche, 5,393 %, fällig 15.11.2028 *	207	0,24
150 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 t±	130	0,15	402 Gannett Holdings LLC, 9,308 %, fällig 15.10.2029 *	401	0,46
440 Starwood Property Trust Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2029	458	0,53	209 Genesee & Wyoming Inc, 6,079 %, fällig 10.04.2031 *	209	0,24
470 Starwood Property Trust Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.04.2030	467	0,54	209 Gray Television, 9,559 %, fällig 23.05.2029 *	199	0,23
170 StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.03.2031	179	0,21	21 Magenta Buyer LLC, 11,301 %, fällig 27.07.2028 *	19	0,02
100 Summit Midstream Holdings LLC, 144A, 8,625 %, fällig 31.10.2029	105	0,12	28 Magenta Buyer LLC, 11,551 %, fällig 27.07.2028 *	15	0,02
260 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	196	0,23	96 Magenta Buyer LLC, 6,051 %, fällig 27.07.2028 *	32	0,04
170 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	165	0,19	46 MRI Software LLC, 9,079 %, fällig 10.02.2027 *	46	0,05
250 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	248	0,29	81 MRI Software LLC, 9,079 %, fällig 10.02.2027 *	80	0,09
490 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	455	0,52	157 Neptune Bidco U.S. Inc, 9,389 %, fällig 11.04.2029 *	140	0,16
460 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	468	0,54	415 Phoenix Guarantor Inc, 6,812 %, fällig 21.02.2031 *	414	0,48
470 Tutor Perini Corp, 144A, 11,875 %, fällig 30.04.2029	519	0,60	210 Quikrete Holdings Inc., 0,000 %, fällig 31.01.2032 *	210	0,24
510 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	492	0,57	650 Rent-A-Center Inc/TX, 7,041 %, fällig 17.02.2028 *	651	0,75
460 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	466	0,54	205 Spirit Airlines, 11,322 %, fällig 18.11.2025 *†	205	0,24
440 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2029	409	0,47	357 Station Casinos LLC, 6,312 %, fällig 14.03.2031 *	357	0,41
210 Univision Communications Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.08.2028	214	0,25	100 United Airlines Inc, 6,297 %, fällig 24.02.2031 *	100	0,11
450 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2029	441	0,51	440 X Corp, 0,000 %, fällig 26.10.2029 *	439	0,50
179 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	155	0,18	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 5.485 \$)	5.296	6,09
650 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	665	0,77	Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,01 % (29. Februar 2024: 0,60 %)		
180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	164	0,19	882 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	882	1,01
120 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	104	0,12	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 882 \$)	882	1,01
210 Venture Global LNG Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2030	213	0,24	Stammaktien – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,33 %)		
630 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig 01.02.2032	689	0,79	Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,33 %)		
450 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	458	0,53	2.640 Credit Suisse Group AG Escrow t±	–	–
460 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	476	0,55	USA – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
330 Viasat Inc, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2031	248	0,28	3 Endo Inc	75	0,09
600 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	607	0,70	510 Par Pharmaceutical Escrow t±	–	–
200 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	217	0,25		75	0,09
120 Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2031	127	0,15	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 463 \$)	75	0,09
800 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	189	0,22	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 91.898 \$)	88.135	101,36
420 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	442	0,51	Credit Default Swaps – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,43 %)		
140 XPLR Infrastructure LP, 144A, 2,500 %, fällig 15.06.2026	133	0,15	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	26	0,03
110 XPLR Infrastructure Operating Partners LP, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2029	109	0,13	Devisenterminkontrakte – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,01 %)		
430 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	444	0,51	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	10	0,01
230 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2032	239	0,27	Futures – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,01 %)		
250 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	227	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	65	0,08
	60.092	69,11	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	88.236	101,48
Sambia – 2,50 % (29. Februar 2024: 0,78 %)			Credit Default Swaps – 0,03 % (29. Februar 2024: -0,22 %)		
720 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig 01.03.2029	769	0,88	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-20	-0,03
480 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	501	0,58	Swaptions – -0,01 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
890 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	908	1,04	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-11	-0,01
	2.178	2,50	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 80.370 \$)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-5	–
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,28 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-36	-0,04
Argentinien – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,28 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	88.200	101,44
58 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,625 %, fällig 01.09.2037	38	0,05	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-1,247	-1,44
617 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	410	0,47	Gesamtvermögen	86.953 \$	100,00
	448	0,52			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,65
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	5,86
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,98
Derivative Finanzinstrumente	0,11
Sonstige Vermögenswerte	2,40
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	American Airlines Group Inc, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	334	\$ 12
Goldman Sachs	Nabors Industries, Inc, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2029	115	-20
Goldman Sachs	Transocean Inc, 1,000 % – Kauf	20. Juni 2029	115	14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 421 \$)				\$ 26
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -219 \$)				-20
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 202 \$)				\$ 6

Aufstellung von Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Stichtag	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Swaption Payer Strike 1,07 %	17. Apr. 2025	1.800	\$ -11
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Swaptions (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nicht realisierte Wertminderung aus Swaptions (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				-11
Nettowertminderung aus Swaptions (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ -11

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	31	Verkauf	SGD	41	\$ –
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	11	–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	765	Verkauf	USD	572	-5
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	3.217	Verkauf	USD	2.378	3
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	10	Verkauf	USD	12	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	1.298	Verkauf	USD	1.341	7
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 14 \$)								\$ 10
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1 \$)								-5
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 13 \$)								\$ 5

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Goldman Sachs	76	\$ 8.203	\$ 65
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 8 \$)				\$ 65
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 8 \$)				\$ 65

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 7,20 % (29. Februar 2024: 0,50 %)			Deutschland – 1,71 % (29. Februar 2024: 3,64 %)		
150 AGL CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class DR, 144A, 6,725 %, fällig 20.01.2035 *	150	0,37	40 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	42	0,10
140 AGL CLO 17 Ltd, Series 2022 17A, Class ER, 144A, 8,953 %, fällig 21.01.2035 *	141	0,34	200 CT Investment GmbH, 6,375 %, fällig 15.04.2030	217	0,53
120 AGL CLO 35 Ltd, Series 2024 35A, Class E, 144A, 9,662 %, fällig 21.01.2038 *	121	0,30	130 Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, Series NOV, 5,375 %, fällig 15.07.2029	139	0,34
100 Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D1NR, 144A, 7,813 %, fällig 23.10.2034 *	102	0,25	45 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	47	0,12
180 Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class DRR, 144A, 7,390 %, fällig 25.01.2038 *	181	0,44	250 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 14.04.2028	253	0,62
150 GoldenTree Loan Management US CLO 16 Ltd, Series 2022 16A, Class DRR, 144A, 6,716 %, fällig 20.01.2038 *	150	0,37		698	1,71
150 Goldentree Loan Management US CLO 6 Ltd, Series 2019 6A, Class ER2, 144A, 0,000 %, fällig 20.04.2035 *	151	0,37	Guatemala – 0,88 % (29. Februar 2024: 1,78 %)		
150 Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class D1, 144A, 7,642 %, fällig 25.10.2037 *	151	0,37	140 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029 *	135	0,33
160 Golub Capital Partners CLO 77 B Ltd, Series 2024 77A, Class E, 144A, 9,146 %, fällig 25.01.2038 *	161	0,40	250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig 27.04.2031	223	0,55
250 Magnette XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,244 %, fällig 15.10.2031 *	251	0,62		358	0,88
110 Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 1A, Class DR, 144A, 7,893 %, fällig 26.08.2034 *	111	0,27	Hongkong – 0,64 % (29. Februar 2024: 0,48 %)		
250 Ocean Trails CLO X, Series 2020 10A, Class ER, 144A, 12,134 %, fällig 15.10.2034 *	250	0,61	137 Add Hero Holdings Ltd, 8,500 %, fällig 30.09.2029	11	0,03
150 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class ER, 144A, 10,633 %, fällig 20.01.2038 *	151	0,37	106 Add Hero Holdings Ltd, 9,000 %, fällig 30.09.2030	3	0,01
150 OHA Credit Funding 11 Ltd, Series 2022 11A, Class D1R, 144A, 7,143 %, fällig 19.07.2037 *	151	0,37	139 Add Hero Holdings Ltd, 9,800 %, fällig 30.09.2031	4	0,01
100 OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class D1, 144A, 7,743 %, fällig 20.04.2037 *	102	0,25	260 Meico Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	242	0,59
100 Palmer Square CLO 2022-3 Ltd, Series 2022 3A, Class D1R, 144A, 7,243 %, fällig 20.07.2037 *	102	0,25		260	0,64
100 Pikes Peak CLO 6, Series 2020 6A, Class ERR, 144A, –, fällig 18.05.2034 *	100	0,25	Irland – 0,70 % (29. Februar 2024: 0,57 %)		
100 PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 0,000 %, fällig 20.04.2038 *	101	0,25	330 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033	287	0,70
100 Trinitas CLO XXVII Ltd, Series 2024 27A, Class D1, 144A, 8,593 %, fällig 18.04.2037 *	103	0,25	Israel – 1,46 % (29. Februar 2024: 2,77 %)		
200 Warwick Capital CLO 3 Ltd, Series 2024 3A, Class D, 144A, 8,793 %, fällig 20.04.2037 *	205	0,50	150 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	145	0,36
			400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	449	1,10
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.915 \$)				594	1,46
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Italien – 1,41 % (29. Februar 2024: 2,25 %)		
100 LHOME Mortgage Trust 2025-RTL1, Series 2025 RTL1, Class M1, 144A, 7,023 %, fällig 25.01.2040 *	101	0,25	520 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	471	1,15
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 100 \$)			EUR 100 TeamSystem SpA, 6,285 %, fällig 31.07.2031 *	105	0,26
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 70,72 % (29. Februar 2024: 77,42 %)				576	1,41
Belgien – 0,26 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Japan – 0,47 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
EUR 100 Azelis Finance NV, 4,750 %, fällig 25.09.2029	108	0,26	200 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,810 %, fällig 17.09.2030	193	0,47
Brasilien – 1,96 % (29. Februar 2024: 1,93 %)			Luxemburg – 2,24 % (29. Februar 2024: 3,07 %)		
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	404	0,99	630 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	495	1,21
450 Mercadolibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	396	0,97	410 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	127	0,31
	800	1,96	404 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	28	0,07
Kanada – 1,51 % (29. Februar 2024: 2,30 %)			GBP 220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	263	0,65
310 Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	318	0,78		913	2,24
180 Open Text Holdings Inc, 4,125 %, fällig 15.02.2030	166	0,41	Macau – 0,46 % (29. Februar 2024: 0,73 %)		
40 Ritchie Bros Holdings Inc, 144A, 7,750 %, fällig 15.03.2031	42	0,10	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	188	0,46
90 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	88	0,22	Mexiko – 2,80 % (29. Februar 2024: 1,88 %)		
	614	1,51	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Ewige Anleihe *	201	0,49
Chile – 0,67 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, Ewige Anleihe *	328	0,81
200 ATP Tower Holdings / Andean Telecom Partners Chile SpA Andean Tower Partners C, 144A, 7,875 %, fällig 03.02.2030	201	0,49	640 BBVA Mexico SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero BBVA Mexico/TX, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	612	1,50
70 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	70	0,18		1.141	2,80
	271	0,67	Marokko – 0,49 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
China – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,04 %)			200 OCP SA, 144A, 4,500 %, fällig 22.10.2025	199	0,49
18 China Aoyuan Group Ltd, Nullkupon, fällig 30.09.2028	–	–	Niederlande – 0,72 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
53 China Aoyuan Group Ltd, 5,500 %, fällig 30.09.2031	1	–	EUR 100 Boels Topholding BV, 5,750 %, fällig 15.05.2030	109	0,26
201 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, Ewige Anleihe †	2	0,01	200 Sunrise FinCo I BV, 4,875 %, fällig 15.07.2031	187	0,46
	3	0,01		296	0,72
Kolumbien – 1,04 % (29. Februar 2024: 0,89 %)			Peru – 0,67 % (29. Februar 2024: 1,21 %)		
280 Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig 19.01.2036	278	0,68	350 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032	272	0,67
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	144	0,36	Slowenien – 0,51 % (29. Februar 2024: 0,43 %)		
	422	1,04	EUR 200 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	208	0,51
Dominikanische Republik – 0,75 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Schweden – 1,31 % (29. Februar 2024: 2,12 %)		
300 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	305	0,75	230 Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2031	234	0,57
Frankreich – 0,86 % (29. Februar 2024: 1,06 %)			EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	300	0,74
450 Altice France SA, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	352	0,86		534	1,31
			Schweiz – 0,64 % (29. Februar 2024: 0,26 %)		
			220 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	221	0,54
			40 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2027	39	0,10
				260	0,64

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
Türkei – 1,65 % (29. Februar 2024: 1,23 %)					
200 Coca-Cola Icecek AS, 144A, 4,500 %, fällig 20.01.2029	191	0,47	20 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	20	0,05
200 Mersin Uluslararası Liman İşletmeciliği AS, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	208	0,51	80 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	79	0,19
270 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 7,375 %, fällig 20.05.2029	276	0,67	100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01.03.2031	80	0,20
	675	1,65	587 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	629	1,54
			89 EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	110	0,27
			335 EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	314	0,77
Vereinigtes Königreich – 6,33 % (29. Februar 2024: 7,09 %)					
EUR 220 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	234	0,57	120 Endo Finance Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.04.2031	129	0,32
EUR 200 888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558 %, fällig 15.07.2027	213	0,52	60 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	64	0,16
200 Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, fällig 12.08.2031	172	0,42	80 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2033	83	0,20
GBP 100 B&M European Value Retail SA, 4,000 %, fällig 15.11.2028	119	0,29	100 Esab Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2029	102	0,25
220 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	202	0,50	320 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	304	0,74
GBP 100 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	124	0,30	220 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	222	0,54
200 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 15.08.2029	210	0,52	90 Garrett Motion Holdings Inc / Garrett LX1 Sarl, 144A, 7,750 %, fällig 31.05.2032	92	0,23
EUR 100 INEOS Quattro Finance 2 Plc, 6,750 %, fällig 15.04.2030	107	0,26	60 Gen Digital Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2033	60	0,15
280 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	294	0,72	140 GLF Environmental Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2031	145	0,36
225 Marks & Spencer Plc, 144A, 7,125 %, fällig 01.12.2037	246	0,60	100 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig 01.11.2033	105	0,26
GBP 510 Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,228 %, fällig 16.07.2035 *	553	1,36	10 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.07.2032	10	0,03
EUR 100 RAY Financing LLC, 6,500 %, fällig 15.07.2031	110	0,27	76 iHeartCommunications Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.05.2029	65	0,16
	2.584	6,33	60 Iron Mountain Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	62	0,15
Vereinigte Republik Tansania – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
200 HTA Group Ltd/Mauritius, 144A, 7,500 %, fällig 04.06.2029	203	0,50	200 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	208	0,51
USA – 35,87 % (29. Februar 2024: 39,38 %)					
60 Adient Global Holdings Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2033	60	0,15	220 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	230	0,56
50 Alpha Generation LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2032	51	0,12	60 JPMorgan Chase & Co, Series OO, 6,500 %, Ewige Anleihe *	62	0,15
80 AMC Networks Inc, 144A, 10,250 %, fällig 15.01.2029	85	0,21	60 Level 3 Financing Inc, 144A, 11,000 %, fällig 15.11.2029	68	0,17
100 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	102	0,25	70 Life Time Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2031	70	0,17
50 American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	53	0,13	120 Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	125	0,31
220 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	202	0,49	70 Masterbrand Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2032	71	0,17
130 APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	131	0,32	40 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	41	0,10
60 Arcosa Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.08.2032	61	0,15	170 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	128	0,31
280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	279	0,68	130 Miter Brands Acquisition Holdco Inc / MIWD Borrower LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.04.2032	133	0,32
200 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	102	0,25	50 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	51	0,13
180 Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31.01.2027	175	0,43	510 NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	522	1,28
20 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	14	0,04	100 Newell Brands Inc, 6,375 %, fällig 15.05.2030	100	0,24
40 Beacon Roofing Supply Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.08.2030	41	0,10	80 NRG Energy Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.11.2034	80	0,20
200 Boost Newco Borrower LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	209	0,51	120 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	121	0,30
180 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	186	0,45	210 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	205	0,50
100 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.03.2030	100	0,25	190 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	193	0,47
80 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	81	0,20	265 Rackspace Finance LLC, 144A, 3,500 %, fällig 15.05.2028	146	0,36
500 Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029	462	1,13	240 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15.10.2026	230	0,56
110 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	102	0,25	450 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	452	1,11
90 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	79	0,19	110 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	102	0,25
150 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	126	0,31	160 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2032	162	0,40
200 Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	181	0,44	230 Service Properties Trust, 8,875 %, fällig 15.06.2032	228	0,56
150 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	134	0,33	110 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	112	0,27
300 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, fällig 01.04.2051	194	0,48	60 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig 15.11.2031	64	0,16
410 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01.04.2061	256	0,63	120 Snap Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2033	122	0,30
300 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	307	0,75	140 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	144	0,35
70 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2030	72	0,18	60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 t.e	52	0,13
120 Cloud Software Group Inc, 144A, 8,250 %, fällig 30.06.2032	125	0,31	220 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 t.e	191	0,47
70 CommScope LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.12.2031	73	0,18	90 Starwood Property Trust Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2029	94	0,23
200 CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	195	0,48	140 Starwood Property Trust Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.04.2030	139	0,34
250 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	178	0,44	150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2027	150	0,37
400 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	293	0,72	50 Summit Midstream Holdings LLC, 144A, 8,625 %, fällig 31.10.2029	53	0,13
60 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	65	0,16	170 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	169	0,41
70 Diebold Nixdorf Inc, 144A, 7,750 %, fällig 31.03.2030	73	0,18	250 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	245	0,60
			450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	416	1,02
			100 United Airlines Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2026	99	0,24
			200 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	193	0,47
			220 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	214	0,52
			50 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.06.2031	52	0,13

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)			Südafrika – 0,47 % (29. Februar 2024: 0,38 %)		
USA – (Fortsetzung)			250 Republik Südafrika, Internationale Staatsanleihe, 5,650 %, fällig 27.09.2047		
140 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	142	0,35		191	0,47
100 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	103	0,25	Türkei – 1,89 % (29. Februar 2024: 1,14 %)		
130 Viasat Inc, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2031	98	0,24	560 Türkei, Internationale Staatsanleihe, Series 11Y, 4,250 %, fällig 14.04.2026		
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	119	0,29	300 Türkei, Internationale Staatsanleihe, Series 30Y, 4,875 %, fällig 16.04.2043		
60 Vistra Operations Co LLC, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2031	63	0,16		217	0,53
230 VWW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	54	0,13		770	1,89
190 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	200	0,49	Ukraine – 0,49 % (29. Februar 2024: 0,27 %)		
90 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2032	94	0,23	12 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2030		
	14.632	35,87	44 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2034		
Sambia – 2,20 % (29. Februar 2024: 0,47 %)			97 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 1,750 %, fällig 01.02.2034		
220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig 01.03.2029	235	0,58	37 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2035		
650 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	663	1,62	76 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 1,750 %, fällig 01.02.2035		
	898	2,20	31 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2036		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 30.533 \$)			43 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 1,750 %, fällig 01.02.2036		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 17,88 % (29. Februar 2024: 18,60 %)				199	0,49
Angola – 0,72 % (29. Februar 2024: 0,60 %)			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.563 \$)		
330 Angola, Internationale Staatsanleihe, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	296	0,72		7.294	17,88
Argentinien – 3,60 % (29. Februar 2024: 2,76 %)			Schuldscheindarlehen – 3,10 % (29. Februar 2024: 1,08 %)		
261 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	190	0,47	178 DCert Buyer, Inc., 8,312 %, fällig 16.10.2026 *		
774 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 4,125 %, fällig 09.07.2035	492	1,21	198 Flutter Entertainment Plc, 6,079 %, fällig 29.11.2030 *		
685 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	454	1,11	100 Quikrete Holdings Inc., 0,000 %, fällig 31.01.2032 *		
340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	331	0,81	108 Spirit Airlines, 11,322 %, fällig 18.11.2025 *†		
	1.467	3,60	199 Station Casinos LLC, 6,312 %, fällig 14.03.2031 *		
Bahrain – 0,65 % (29. Februar 2024: 0,52 %)			198 TK Elevator U.S. Newco Inc, 7,746 %, fällig 11.04.2030 *		
310 Bahrain, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,000 %, fällig 19.09.2044	265	0,65	300 VWW International Inc, 8,052 %, fällig 13.04.2028 *		
Brasilien – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			210 X Corp, 0,000 %, fällig 26.10.2029 *		
200 Brasilien, Internationale Staatsanleihe, 6,000 %, fällig 07.04.2026	202	0,50		1.263	3,10
Costa Rica – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,42 %)			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 1.437 \$)		
200 Costa-Rica, Internationale Staatsanleihe, 6,125 %, fällig 19.02.2031	203	0,50	Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,42 %)		
Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,91 % (29. Februar 2024: 0,74 %)			China – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
410 Côte d'Ivoire, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	370	0,91	HKD 50 China Aoyuan Group Ltd †		
Dominikanische Republik – 0,87 % (29. Februar 2024: 1,97 %)			Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,42 %)		
380 Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	356	0,87	1.680 Credit Suisse Group AG Escrow †∞		
Ecuador – 0,60 % (29. Februar 2024: 0,55 %)				2	–
460 Ecuador, Internationale Staatsanleihe, 144A, Nullkupon, fällig 31.07.2030	244	0,60	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)		
Ägypten – 1,54 % (29. Februar 2024: 1,21 %)				2	–
300 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 6,588 %, fällig 21.02.2028	287	0,70	Real Estate Investment Trusts – 0,45 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
350 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	341	0,84	USA – 0,45 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
	628	1,54	4 AGNC Investment Corp, Series F *		
Jordanien – 1,10 % (29. Februar 2024: 0,92 %)			1 Chimera Investment Corp, Series C *		
440 Jordanien, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	450	1,10	2 MFA Financial Inc, Series C *		
Kenia – 0,48 % (29. Februar 2024: 0,38 %)				185	0,45
200 Republik Kenia, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,250 %, fällig 28.02.2028	196	0,48	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 183 \$)		
Nigeria – 1,51 % (29. Februar 2024: 1,20 %)				185	0,45
360 Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,143 %, fällig 23.02.2030	338	0,83	Optionsscheine – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
300 Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,875 %, fällig 16.02.2032	280	0,68	USA – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
	618	1,51	4 flyExclusive Inc		
Oman – 0,51 % (29. Februar 2024: 0,42 %)				1	–
200 Oman, Internationale Staatsanleihe, 6,750 %, fällig 17.01.2048	209	0,51	Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 3 \$)		
Panama – 1,16 % (29. Februar 2024: 0,94 %)				1	–
650 Panama, Internationale Staatsanleihe, 2,252 %, fällig 29.09.2032	475	1,16	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 42.734 \$)		
Senegal – 0,38 % (29. Februar 2024: 0,34 %)				40.625	99,60
230 Senegal, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,750 %, fällig 13.03.2048	155	0,38	Credit Default Swaps – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				35	0,09
			Devisenterminkontrakte – 0,10 % (29. Februar 2024: 0,07 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				39	0,10
			Futures – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,02 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				57	0,14
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
				40.756	99,93
			Devisenterminkontrakte – -0,16 % (29. Februar 2024: -0,05 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-65	-0,16
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-65	-0,16
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
				40.691	99,77
			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				98	0,23
			Gesamt Nettovermögen		
				40.789 \$	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 25.790.000 \$ und machten 63,24 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- c Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2025 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
- HKD – Hongkong-Dollar

	% des Gesamtvermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,85
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	2,98
Derivative Finanzinstrumente	0,31
Sonstige Vermögenswerte	3,86
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
UBS	CDX.NA.HY, 5.000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	475	\$ 35
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ 35
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ 35

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3. März 2025	BNY	Kauf	USD	35	Verkauf	AUD	56	\$ 1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	383	Verkauf	AUD	604	8
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	27	Verkauf	EUR	26	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	48	Verkauf	GBP	38	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	563	Verkauf	SGD	755	6
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	8	Verkauf	SGD	10	–
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD	6.192	Verkauf	USD	3.893	-51
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	118	Verkauf	USD	88	-1
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	2.495	Verkauf	USD	1.844	3
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	550	Verkauf	USD	681	10
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	855	Verkauf	USD	884	4
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	USD	669	Verkauf	GBP	543	-13
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	EUR	1.375	Verkauf	USD	1.422	7
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 34 \$)								\$ 39
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -24 \$)								-65
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 10 \$)								\$ -26

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency März 2025	UBS	-23	\$ -2,983	\$ 57
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 8 \$)				\$ 57
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 8 \$)				\$ 57

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 4,54 % (29. Februar 2024: 10,61 %)			
Frankreich – 3,07 % (29. Februar 2024: 2,33 %)			
SGD	8.000 Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	5.920	3,07
Malaysia – 0,61 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	1.250 Petronas Capital Ltd, 3,500 %, fällig 21.04.2030	1.177	0,61
Spanien – 0,86 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
SGD	2.250 Banco Santander SA, 3,600 %, fällig 23.10.2030 *	1.672	0,86
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.748 \$)			
		8.769	4,54
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 91,47 % (29. Februar 2024: 86,27 %)			
China – 19,56 % (29. Februar 2024: 19,09 %)			
CNY	87.000 Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	12.992	6,73
CNH	66.500 Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	9.872	5,12
CNY	53.500 Chinesische Staatsanleihe, Serie INBK, 3,120 %, fällig 25.10.2052	9.026	4,68
CNY	40.000 Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig 23.03.2030	5.849	3,03
		37.739	19,56
Hongkong – 0,66 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	1.250 Airport Authority, 4,875 %, fällig 15.07.2030	1.273	0,66
Indien – 12,32 % (29. Februar 2024: 11,08 %)			
INR	100.000 Indische Staatsanleihe, Serie SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	1.176	0,61
INR	300.000 Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	3.488	1,81
INR	350.000 Indische Staatsanleihe, 7,610 %, fällig 09.05.2030	4.162	2,16
INR	300.000 Indische Staatsanleihe, 7,260 %, fällig 22.08.2032	3.539	1,83
INR	190.000 Indische Staatsanleihe, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2.143	1,11
INR	460.000 Indische Staatsanleihe, 7,180 %, fällig 24.07.2037	5.397	2,79
INR	330.000 Indische Staatsanleihe, 7,300 %, fällig 19.06.2053	3.874	2,01
		23.779	12,32
Indonesien – 7,18 % (29. Februar 2024: 8,48 %)			
IDR	71.585.000 Indonesische Schatzanleihe, Serie FR97, 7,125 %, fällig 15.06.2043	4.363	2,26
IDR	160.000.000 Indonesien, Schatzanleihe, Series FR89, 6,875 %, fällig 15.08.2051	9.484	4,92
		13.847	7,18
Malaysia – 14,84 % (29. Februar 2024: 11,52 %)			
MYR	38.270 Malaysia, Staatsanleihe, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	8.672	4,49
MYR	6.000 Malaysia, Staatsanleihe, Series 0220, 2,632 %, fällig 15.04.2031	1.264	0,66
MYR	26.950 Malaysia, Staatsanleihe, Series 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	5.976	3,10
MYR	53.370 Malaysische Staatsanleihe, Serie 0318, 4,642 %, fällig 07.11.2033	12.715	6,59
		28.627	14,84
Philippinen – 6,68 % (29. Februar 2024: 5,03 %)			
PHP	756.000 Philippinen, Internationale Staatsanleihe, 6,250 %, fällig 14.01.2036	12.881	6,68
Singapur – 4,89 % (29. Februar 2024: 4,74 %)			
SGD	6.500 Singapurische Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	4.771	2,47
SGD	6.090 Singapur, Staatsanleihe, 3,000 %, fällig 01.08.2072	4.674	2,42
		9.445	4,89
Südkorea – 15,84 % (29. Februar 2024: 15,28 %)			
	1.250 Korea Development Bank/The, 4,875 %, fällig 03.02.2030	1.277	0,66
	1.250 Korea Housing Finance Corp, 5,125 %, fällig 21.01.2030	1.283	0,66
	1.250 Korea National Oil Corp, 4,250 %, fällig 30.09.2029	1.231	0,64
KRW	4.300.000 Koreanische Staatsanleihe, Serie 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	2.774	1,44
KRW	6.300.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	4.037	2,09
KRW	13.200.000 koreanische Staatsanleihe, Serie 3206, 3,375 %, fällig 10.06.2032	9.449	4,90

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
KRW	13.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	7.274	3,77
KRW	4.100.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 5403, 3,250 %, fällig 10.03.2054	3.242	1,68
		30.567	15,84
Thailand – 9,50 % (29. Februar 2024: 7,55 %)			
THB	165.000 Thailand, Staatsanleihe, 2,050 %, fällig 17.04.2028	4.853	2,52
THB	26.440 Thailändische Staatsanleihe, 2,800 %, fällig 17.06.2034	816	0,42
THB	389.730 Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	12.663	6,56
		18.332	9,50
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 191.967 \$)			
		176.490	91,47
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,82 % (29. Februar 2024: 2,18 %)			
	5.439 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	5.439	2,82
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5.439 \$)			
		5.439	2,82
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 206.154 \$)			
		190.698	98,83
Devisenterminkontrakte – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,01 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	89	0,04
Futures – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	21	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
		190.808	98,88
Devisenterminkontrakte – -0,09 % (29. Februar 2024: -0,07 %)			
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-176	-0,09
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
		-176	-0,09
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
		190.632	98,79
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
		2.327	1,21
Gesamtvermögen			
		192.959 \$	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 %.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz: Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

ABKÜRZUNGEN:

CNY	– Chinesischer Renminbi
CNH	– 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

	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,61
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,81
Derivative Finanzinstrumente	0,06
Sonstige Vermögenswerte	1,52
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	109	Verkauf	AUD	172	\$ 2
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	253	Verkauf	CNH	1.844	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	521	Verkauf	CNH	3.779	3
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	20	Verkauf	SGD	27	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	207	Verkauf	SGD	278	2
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	12	Verkauf	USD	8	–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	2.632	Verkauf	USD	1.946	3
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	36	Verkauf	USD	38	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	3.323	Verkauf	USD	3.433	16
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH	2.300	Verkauf	USD	317	-2
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH	212.617	Verkauf	USD	29.133	35
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF	–	Verkauf	USD	–	–
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF	14	Verkauf	USD	15	–
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD	13.522	Verkauf	USD	8.500	-109
26. März 2025	BNY	Kauf	SGD	7.100	Verkauf	USD	5.325	-65
12. Mai 2025	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD	3.000	Verkauf	KRW	4.328.100	28
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 34 \$)								\$ 89
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -182 \$)								-176
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -148 \$)								\$ -87

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond März 2025	UBS	67	\$ 5.485
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)			\$ 21
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -82 \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -82 \$)			\$ 21

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

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 – 94,88 % (29. Februar 2024: 93,20 %)			Vereinigtes Königreich – 12,08 % (29. Februar 2024: 10,98 %)		
Australien – 1,21 % (29. Februar 2024: 0,14 %)			GBP 1.700 British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	1.912	1,07
EUR 1.400 National Australia Bank Ltd, Series ermtN, 3,125 %, fällig 28.02.2030	1.475	0,83	EUR 400 CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, fällig 13.04.2025	414	0,23
EUR 720 Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, fällig 20.06.2029	688	0,38	EUR 1.500 Coventry Building Society, 3,125 %, fällig 29.10.2029	1.556	0,87
	2.163	1,21	EUR 550 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, fällig 12.09.2026	559	0,31
Belgien – 0,96 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			EUR 1.200 GSK Capital BV, 3,125 %, fällig 28.11.2032	1.255	0,70
EUR 1.600 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,450 %, fällig 22.09.2031	1.706	0,96	390 HSBC Holdings Plc, 1,645 %, fällig 18.04.2026 *	388	0,22
Kanada – 1,70 % (29. Februar 2024: 1,88 %)			GBP 300 HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 22.07.2028 *	361	0,20
GBP 500 Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028	635	0,36	600 HSBC Holdings Plc, 6,161 %, fällig 09.03.2029 *	623	0,35
GBP 1.980 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	2.396	1,34	1.500 Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, fällig 24.08.2030 *	1.559	0,87
	3.031	1,70	GBP 1.250 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	1.360	0,76
Dänemark – 1,21 % (29. Februar 2024: 0,99 %)			EUR 1.560 Motability Operations Group Plc, 0,125 %, fällig 20.07.2028	1.485	0,83
1.200 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	1.192	0,67	GBP 990 Nationwide Building Society, 6,178 %, fällig 07.12.2027 *	1.273	0,71
EUR 930 Danske Bank A/S, 3,250 %, fällig 14.01.2033 *	974	0,54	GBP 900 Nationwide Building Society, 6,125 %, fällig 21.08.2028	1.180	0,66
	2.166	1,21	GBP 500 NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	654	0,37
Frankreich – 7,70 % (29. Februar 2024: 9,01 %)			GBP 1.640 Northern Powergrid Yorkshire Plc, 5,625 %, fällig 14.11.2033	2.118	1,19
EUR 1.900 Aeroports de Paris SA, 3,375 %, fällig 16.05.2031	2.006	1,12	EUR 2.200 Segro Capital Sarl, 0,500 %, fällig 22.09.2031	1.918	1,08
EUR 800 APRR SA, 1,500 %, fällig 25.01.2030	778	0,44	EUR 550 Unilever Finance Netherlands BV, 1,125 %, fällig 12.02.2027	557	0,31
EUR 600 BNP Paribas SA, 1,375 %, fällig 28.05.2029	583	0,33	EUR 1.500 Unilever Finance Netherlands BV, 3,250 %, fällig 15.02.2032	1.593	0,89
2.470 BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, fällig 09.01.2030 *	2.500	1,40	EUR 810 Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig 21.01.2027	820	0,46
EUR 1.200 Bouygues SA, 0,500 %, fällig 11.02.2030	1.113	0,62		21.585	12,08
EUR 2.600 Credit Agricole SA, 3,125 %, fällig 26.02.2032	2.713	1,52	USA – 47,77 % (29. Februar 2024: 41,42 %)		
EUR 300 Credit Agricole SA/London, 1,750 %, fällig 05.03.2029	297	0,17	EUR 2.000 Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, fällig 19.11.2027	1.956	1,09
EUR 600 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADI, 1,000 %, fällig 19.10.2026	607	0,34	700 AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	708	0,40
EUR 1.100 TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, fällig 04.03.2027	1.109	0,62	1.800 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	1.820	1,02
GBP 1.700 Vinci SA, 2,250 %, fällig 15.03.2027	2.046	1,14	1.700 Adobe Inc, 2,150 %, fällig 01.02.2027	1.636	0,92
	13.752	7,70	2.000 Alphabet Inc, 0,800 %, fällig 15.08.2027	1.847	1,03
Deutschland – 0,80 % (29. Februar 2024: 4,83 %)			1.400 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	1.212	0,68
EUR 1.500 HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01.11.2028	1.432	0,80	470 American Express Co, 5,085 %, fällig 30.01.2031 *	476	0,27
Irland – 1,70 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			EUR 2.230 Athene Global Funding, 3,410 %, fällig 25.02.2030	2.334	1,31
EUR 2.900 GAS Networks Ireland, 3,250 %, fällig 12.09.2030	3.039	1,70	EUR 800 Bank of America Corp, 3,648 %, fällig 31.03.2029 *	851	0,48
Japan – 1,05 % (29. Februar 2024: 1,54 %)			EUR 2.550 Blackstone Holdings Finance Co LLC, 1,000 %, fällig 05.10.2026	2.573	1,44
EUR 2.000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, fällig 23.10.2029	1.868	1,05	588 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	563	0,31
Luxemburg – 0,75 % (29. Februar 2024: 0,48 %)			1.700 Caterpillar Inc, 2,600 %, fällig 09.04.2030	1.561	0,87
EUR 1.325 Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	1.334	0,75	1.300 Chubb INA Holdings LLC, 0,875 %, fällig 15.06.2027	1.294	0,72
Niederlande – 5,79 % (29. Februar 2024: 6,10 %)			EUR 800 Chubb INA Holdings LLC, 1,550 %, fällig 15.03.2028	801	0,45
GBP 700 ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	889	0,50	2.900 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	2.584	1,45
EUR 1.470 Alliantier NV, 2,625 %, fällig 09.09.2027	1.529	0,86	1.300 Colgate-Palmolive Co, 0,500 %, fällig 06.03.2026	1.323	0,74
GBP 1.900 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, fällig 17.04.2029 *	2.399	1,34	1.200 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	1.185	0,66
EUR 1.300 ING Groep NV, 0,875 %, fällig 29.11.2030 *	1.227	0,69	1.800 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	1.688	0,94
EUR 1.910 Tennet Holding BV, 1,625 %, fällig 17.11.2026	1.950	1,09	2.000 Eaton Capital ULC, 3,601 %, fällig 21.05.2031	2.137	1,20
EUR 1.000 Vesteda Finance BV, 2,000 %, fällig 10.07.2026	1.028	0,57	2.000 Ecolab Inc, 2,125 %, fällig 01.02.2032	1.700	0,95
EUR 1.500 Vesteda Finance BV, 0,750 %, fällig 18.10.2031	1.323	0,74	900 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	892	0,50
	10.345	5,79	2.000 Estee Lauder Cos Inc/The, 2,375 %, fällig 01.12.2029	1.809	1,01
Norwegen – 2,98 % (29. Februar 2024: 2,79 %)			GBP 1.440 Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29.10.2025	1.765	0,99
EUR 940 Avinor AS, 0,750 %, fällig 01.10.2030	866	0,48	1.830 Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	1.816	1,02
GBP 700 DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027 *	870	0,49	3.500 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,600 %, fällig 07.02.2030	3.166	1,77
EUR 1.000 Equinor ASA, 0,750 %, fällig 22.05.2026	1.016	0,57	1.480 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	1.353	0,76
EUR 540 Equinor ASA, 1,250 %, fällig 17.02.2027	547	0,31	900 Honeywell International Inc, 5,000 %, fällig 15.02.2033	909	0,51
EUR 620 Statkraft AS, 2,875 %, fällig 13.09.2029	648	0,36	1.800 Hyundai Capital America, 144A, 5,400 %, fällig 24.06.2031	1.833	1,03
EUR 1.300 Statkraft AS, 3,375 %, fällig 22.03.2032	1.380	0,77	2.100 Illinois Tool Works Inc, 3,250 %, fällig 17.05.2028	2.220	1,24
	5.327	2,98	2.050 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	2.018	1,13
Singapur – 0,18 % (29. Februar 2024: 1,19 %)			EUR 1.110 JPMorgan Chase & Co, 3,588 %, fällig 23.01.2036 *	1.164	0,65
EUR 300 Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig 15.02.2027	315	0,18	240 Kimberly-Clark Corp, 1,050 %, fällig 15.09.2027	221	0,12
Spanien – 2,74 % (29. Februar 2024: 2,68 %)			910 Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, fällig 01.11.2028	898	0,50
EUR 1.900 Aena SME SA, 4,250 %, fällig 13.10.2030	2.092	1,17	2.000 Mastercard Inc, 1,000 %, fällig 22.02.2029	1.958	1,10
EUR 2.000 Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	2.025	1,14	3.000 Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10.12.2028	2.748	1,54
EUR 700 Banco Santander SA, 4,250 %, fällig 12.06.2030	774	0,43	2.400 Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	2.344	1,31
	4.891	2,74	2.790 Morgan Stanley, 0,495 %, fällig 26.10.2029 *	2.657	1,49
Supranational – 0,76 % (29. Februar 2024: 1,54 %)			EUR 680 Nestle Finance International Ltd, 1,500 %, fällig 01.04.2030	670	0,37
GBP 1.090 International Finance Facility for Immunisation Co, 2,750 %, fällig 07.06.2025	1.365	0,76	1.500 Nestle Holdings Inc, 144A, 5,250 %, fällig 13.03.2026	1.514	0,85
Schweden – 2,35 % (29. Februar 2024: 2,00 %)			1.700 Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	1.822	1,02
EUR 2.190 Hemso Treasury Oyj, 0,000 %, fällig 19.01.2028	2.094	1,17	1.600 NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	1.490	0,83
EUR 2.000 Vattenfall AB, 3,750 %, fällig 18.10.2026	2.113	1,18	1.260 PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	1.523	0,85
	4.207	2,35	2.400 PepsiCo Singapore Financing I Pte Ltd, 4,550 %, fällig 16.02.2029	2.413	1,35
Schweiz – 3,15 % (29. Februar 2024: 4,86 %)			2.000 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, fällig 19.05.2030	2.009	1,12
EUR 1.480 ABB Finance BV, 3,250 %, fällig 16.01.2027	1.557	0,87	900 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	892	0,50
EUR 800 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	795	0,45	2.600 Public Storage Operating Co, 0,500 %, fällig 09.09.2030	2.352	1,32
EUR 1.050 Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.05.2030	1.133	0,63	2.000 Roche Holdings Inc, 144A, 1,930 %, fällig 13.12.2028	1.832	1,03
2.150 UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027 *	2.152	1,20	1.040 Sanofi SA, 3,625 %, fällig 19.06.2028	1.019	0,57
	5.637	3,15	2.400 Schneider Electric SE, 3,125 %, fällig 13.10.2029	2.543	1,42
			1.700 Shell Finance US Inc, 2,750 %, fällig 06.04.2030	1.561	0,87
			1.630 TJX Cos Inc/The, 1,600 %, fällig 15.05.2031	1.370	0,77
			GBP 1.340 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, fällig 19.11.2026	1.581	0,88

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)		
USA – (Fortsetzung)		
500 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, fällig 15.02.2033	511	0,29
251 Walmart Inc, 2,375 %, fällig 24.09.2029	233	0,13
	85.355	47,77
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 180.052 \$)	169.518	94,88
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,48 % (29. Februar 2024: 0,23 %)		
4.433 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Klasse WA (ausschüttend)	4.433	2,48
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.433 \$)	4.433	2,48
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 184.485 \$)	173.951	97,36
Devisenterminkontrakte – 0,76 % (29. Februar 2024: 0,60 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.358	0,76
Futures – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,14 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	416	0,23
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	175.725	98,35
Credit Default Swaps – 0,13 % (29. Februar 2024: -0,10 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-240	-0,13
Devisenterminkontrakte – -0,09 % (29. Februar 2024: -0,04 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-156	-0,09
Futures – -0,12 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-218	-0,12
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-614	-0,34
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	175.111	98,01
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	3.552	1,99
Gesamtnettovermögen	178.663 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.871.000 \$ und machten 4,98 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

- ABKÜRZUNGEN:**
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,71
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,45
Derivative Finanzinstrumente	0,98
Sonstige Vermögenswerte	2,86
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. 2029	11.000	\$ -240
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -498 \$)				-240
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -498 \$)				\$ -240

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 167	Verkauf	CHF 149	\$ 2	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 463	Verkauf	EUR 448	-1	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 984	Verkauf	EUR 936	11	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 454	Verkauf	GBP 365	-6	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 1.418	Verkauf	GBP 1.124	6	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 117	Verkauf	SEK 1.264	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 160	Verkauf	SEK 1.754	-2	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 213	Verkauf	USD 223	-3	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 11.429	Verkauf	USD 11.806	58	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 57.381	Verkauf	USD 71.084	1.092	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 344	Verkauf	USD 433	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	SEK 64.524	Verkauf	USD 5.926	71	
14. März 2025	BNY	Kauf	SEK 196	Verkauf	USD 18	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF 4.121	Verkauf	USD 4.542	28	
13. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 80.084	Verkauf	EUR 76.937	-40	
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 7.234	Verkauf	EUR 6.885	64	
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 24.910	Verkauf	GBP 19.875	-86	
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 187	Verkauf	GBP 148	1	
13. Mai 2025	Citi	Kauf	EUR 2.478	Verkauf	USD 2.596	-15	
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD 204	Verkauf	EUR 194	2	
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR 269	Verkauf	USD 280	–	

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. Mai 2025	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	240	Verkauf	JPY	36.227	\$ -3
13. Mai 2025	UBS	Kauf	USD	1.825	Verkauf	EUR	1.730	23
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 2.849 \$)								\$ 1.358
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -177 \$)								-156
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 2.672 \$)								\$ 1.202

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-279	\$ -34,123	\$ 203
Euro-Bund März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-67	-9,257	177
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-26	-2,888	-46
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-62	-7,083	-170
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	35	7,244	36
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-5	-540	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 638 \$)				\$ 416
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -82 \$)				-218
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 556 \$)				\$ 198

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 15,28 % (29. Februar 2024: 17,49 %)					
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	94	0,10	71 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig 20.12.2050	60	0,06
200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	160	0,16	88 Ginnie Mae II Pool 'BZ4350', 2,500 %, fällig 20.03.2051	74	0,08
200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	167	0,17	64 Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500 %, fällig 20.05.2051	55	0,06
2.800 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	2.439	2,51	110 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20.06.2044	102	0,11
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	91	0,09	12 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	11	0,01
400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	394	0,40	12 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	12	0,01
1.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	1.202	1,24	16 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20.11.2046	14	0,01
800 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	813	0,84	11 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	10	0,01
400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,500 % ±	412	0,42	16 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig 20.11.2047	14	0,02
1 Fannie Mae Pool 'Z55984', 4,500 %, fällig 01.11.2025	1	–	12 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20.11.2047	12	0,01
45 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	42	0,04	43 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20.02.2048	40	0,04
59 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01.05.2045	56	0,06	9 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig 20.04.2048	8	0,01
18 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01.01.2045	17	0,02	49 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	48	0,05
44 Fannie Mae Pool 'AS8951', 3,500 %, fällig 01.03.2047	41	0,04	17 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	17	0,02
15 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 01.06.2047	15	0,02	24 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	23	0,02
273 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, fällig 01.07.2044	256	0,26	8 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20.09.2048	8	0,01
27 Fannie Mae Pool 'BC9077', 3,500 %, fällig 01.12.2046	25	0,03	34 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	33	0,03
77 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	71	0,07	21 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	21	0,02
81 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 01.10.2048	80	0,08	63 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	54	0,06
31 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	29	0,03	204 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	182	0,19
22 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 01.11.2048	22	0,02	300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	290	0,30
31 Fannie Mae Pool 'BP1585', 3,500 %, fällig 01.01.2050	28	0,03	600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	593	0,61
60 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	49	0,05	700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	702	0,72
62 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	0,05	300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	304	0,31
72 Fannie Mae Pool 'BT5574', 2,500 %, fällig 01.08.2051	61	0,06	200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,500 % ±	204	0,21
225 Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, fällig 01.11.2051	183	0,19	94 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	4	–
39 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 01.07.2048	38	0,04	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 15.492 \$)		
78 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 01.08.2048	76	0,08	14.874	15,28	
38 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, fällig 01.10.2048	37	0,04	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 25,94 % (29. Februar 2024: 24,82 %)		
246 Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000 %, fällig 01.07.2050	199	0,20	Belgien – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,24 %)		
22 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, fällig 01.06.2049	20	0,02	149 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	139	0,14
97 Fannie Mae Pool 'FM1578', 3,500 %, fällig 01.09.2034	94	0,10	Brasilien – 0,53 % (29. Februar 2024: 0,77 %)		
57 Fannie Mae Pool 'FM1757', 3,500 %, fällig 01.10.2034	55	0,06	230 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	231	0,24
120 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	120	0,12	330 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	282	0,29
60 Fannie Mae Pool 'FM3215', 3,500 %, fällig 01.01.2049	55	0,06	513	0,53	
228 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	218	0,22	Kanada – 0,62 % (29. Februar 2024: 0,69 %)		
72 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01.07.2051	61	0,06	EUR 230 Bank of Montreal, 2,750 %, fällig 15.06.2027	239	0,24
74 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	63	0,07	GBP 300 Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig 14.06.2027	369	0,38
72 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01.10.2051	61	0,06	608	0,62	
156 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	136	0,14	China – 0,02 % (29. Februar 2024: 0,01 %)		
78 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	66	0,07	20 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	20	0,02
78 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01.02.2052	69	0,07	Dänemark – 0,89 % (29. Februar 2024: 0,52 %)		
81 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01.02.2052	69	0,07	EUR 190 Carlsberg Breweries A/S, 3,500 %, fällig 28.02.2035	199	0,20
82 Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500 %, fällig 01.01.2053	79	0,08	EUR 600 Danske Bank A/S, 4,750 %, fällig 21.06.2030 *	667	0,69
86 Fannie Mae Pool 'FS4454', 6,000 %, fällig 01.04.2053	88	0,09	866	0,89	
256 Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, fällig 01.11.2048	237	0,24	Frankreich – 1,24 % (29. Februar 2024: 0,89 %)		
66 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 01.10.2050	53	0,06	200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	199	0,20
51 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01.04.2038	47	0,05	GBP 300 BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	348	0,36
18 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, fällig 01.04.2049	17	0,02	EUR 500 BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028 *	493	0,51
14 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 2,491 %, fällig 01.03.2047 *	14	0,01	200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	170	0,17
32 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 01.02.2050	29	0,03	1.210	1,24	
62 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	0,05	Deutschland – 1,33 % (29. Februar 2024: 0,96 %)		
152 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	128	0,13	EUR 500 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	518	0,53
72 Freddie Mac Pool 'QC6768', 3,000 %, fällig 01.09.2051	63	0,07	EUR 900 Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032	773	0,80
81 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01.02.2052	69	0,07	1.291	1,33	
175 Freddie Mac Pool 'RA8694', 5,000 %, fällig 01.04.2053	174	0,18	Israel – 0,73 % (29. Februar 2024: 0,53 %)		
31 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	26	0,03	720 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	709	0,73
62 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	51	0,05	Luxemburg – 0,91 % (29. Februar 2024: 0,76 %)		
74 Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, fällig 01.01.2051	72	0,07	330 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	259	0,27
72 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig 01.07.2051	61	0,06	EUR 620 Logisor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	623	0,64
155 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01.01.2052	137	0,14	882	0,91	
300 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	286	0,29	Spanien – 0,94 % (29. Februar 2024: 0,70 %)		
148 Freddie Mac Pool 'SD2384', 6,500 %, fällig 01.02.2053	154	0,16	EUR 400 Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	444	0,46
82 Freddie Mac Pool 'SD2578', 6,000 %, fällig 01.03.2053	84	0,09	EUR 500 Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.09.2032	472	0,48
153 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	130	0,13	916	0,94	
571 Freddie Mac Pool 'SI2106', 2,500 %, fällig 01.05.2051	481	0,49	Schweiz – 0,66 % (29. Februar 2024: 0,50 %)		
54 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, fällig 01.04.2049	51	0,05	EUR 290 UBS Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	301	0,31
51 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig 01.06.2041	52	0,05	EUR 100 UBS Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *	102	0,10
89 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, fällig 01.06.2038	88	0,09	250 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	241	0,25
30 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, fällig 01.05.2047	29	0,03	644	0,66	
42 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	38	0,04			
302 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	284	0,29			
15 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	14	0,01			
9 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	8	0,01			
37 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	34	0,04			
25 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	23	0,02			
22 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	20	0,02			
14 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	13	0,01			
66 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, fällig 20.12.2050	53	0,06			
129 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000 %, fällig 20.12.2050	104	0,11			
68 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, fällig 20.12.2050	55	0,06			
131 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000 %, fällig 20.12.2050	106	0,11			
64 Ginnie Mae II Pool 'B58546', 2,500 %, fällig 20.12.2050	54	0,06			

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)							
Vereinigte Arabische Emirate – 0,80 % (29. Februar 2024: 0,59 %)							
	530 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036	444	0,45		880 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	789	0,81
EUR	400 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	340	0,35		440 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	400	0,41
		784	0,80		20 JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, fällig 14.09.2033 *	21	0,02
Vereinigtes Königreich – 2,52 % (29. Februar 2024: 2,88 %)							
GBP	10 Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14.11.2036 *	13	0,01		30 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	23	0,02
GBP	100 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	123	0,13		60 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	49	0,05
EUR	300 HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027 *	312	0,32	EUR	40 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	42	0,04
GBP	1.000 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	1.263	1,30	EUR	10 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	10	0,01
EUR	140 Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	137	0,14		760 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	718	0,74
EUR	190 Segro Plc, 3,500 %, fällig 24.09.2032	198	0,20		380 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	327	0,34
	460 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	404	0,42		30 Morgan Stanley, 6,342 %, fällig 18.10.2033 *	32	0,03
		2.450	2,52	EUR	500 Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	536	0,55
USA – 14,61 % (29. Februar 2024: 13,90 %)							
	50 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	50	0,05	EUR	380 Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, fällig 16.02.2032	331	0,34
	120 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	112	0,12		271 Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, fällig 08.02.2034	243	0,25
	240 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	204	0,21		80 Shell Finance US Inc, 2,750 %, fällig 06.04.2030	73	0,08
	80 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	68	0,07		90 Shell Finance US Inc, 4,375 %, fällig 11.05.2045	78	0,08
	40 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	34	0,04		60 Shell Finance US Inc, 3,250 %, fällig 06.04.2050	42	0,04
	50 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	42	0,04		10 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	12	0,01
	174 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	147	0,15		4 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	5	–
	20 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	14	0,01		60 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	53	0,05
	30 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	30	0,03		100 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	106	0,11
	835 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	749	0,77		10 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	10	0,01
	360 Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	359	0,37		90 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	83	0,09
	110 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	105	0,11		160 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	153	0,16
	130 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	108	0,11		20 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	18	0,02
	100 Carnival Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.05.2029	100	0,10		100 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	93	0,09
	24 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	24	0,02		150 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	130	0,13
	60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	59	0,06	EUR	100 T-Mobile USA Inc, 3,700 %, fällig 08.05.2032	107	0,11
	160 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	159	0,16		140 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	103	0,11
	110 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	97	0,10		220 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	201	0,21
	110 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053	91	0,09		50 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	51	0,05
	110 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	97	0,10		50 Verizon Communications Inc, 2,355 %, fällig 15.03.2032	42	0,04
	270 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	268	0,28		160 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	154	0,16
	230 Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	176	0,18		50 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	50	0,05
	80 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	71	0,07		10 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	9	0,01
	130 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	131	0,13		10 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	10	0,01
	50 Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09.03.2026	50	0,05		160 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	157	0,16
	300 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	299	0,31		410 Wells Fargo & Co, 4,897 %, fällig 25.07.2033 *	405	0,42
	260 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	258	0,27		770 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	712	0,73
	93 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	89	0,09			14.218	14,61
	50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	45	0,05	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.552 \$)			
	66 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	52	0,05			25.250	25,94
	250 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	157	0,16	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 49,42 % (29. Februar 2024: 55,88 %)			
	51 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	40	0,04	Australien – 2,88 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	27 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	16	0,02	AUD	4.710 Australische Staatsanleihe, Serie 167, 3,750 %, fällig 21.05.2034	2.810	2,88
	360 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	264	0,27	Belgien – 0,37 % (29. Februar 2024: 0,57 %)			
	90 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	85	0,09	EUR	330 Staatsanleihe des Königreichs Belgien, Serie 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	358	0,37
	280 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	243	0,25	Brasilien – 1,89 % (29. Februar 2024: 1,73 %)			
	40 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	38	0,04	BRL	13.337 Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.836	1,89
	60 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	53	0,05	Kanada – 1,72 % (29. Februar 2024: 1,59 %)			
	60 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	41	0,04	CAD	740 Kanadische Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.06.2033	509	0,52
	310 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	292	0,30	CAD	900 Province of Ontario Canada, 3,450 %, fällig 02.06.2045	569	0,59
	10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,01	CAD	940 Province of Quebec Canada, 3,500 %, fällig 01.12.2045	596	0,61
	180 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	171	0,18			1.674	1,72
	230 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	192	0,20	Frankreich – 1,91 % (29. Februar 2024: 1,65 %)			
	520 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	474	0,49	EUR	1.510 Staatsanleihe der französischen Republik OAT, Serie OAT, 144A, 0,000 %, fällig 25.05.2032	1.281	1,32
	20 Freport-McMoran Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	19	0,02	EUR	590 Staatsanleihe der französischen Republik OAT, Serie OAT, 144A, 1,500 %, fällig 25.05.2050	400	0,41
	10 General Motors Co, 5,200 %, fällig 01.04.2045	9	0,01	EUR	160 Staatsanleihe der französischen Republik OAT, Serie OAT, 144A, 4,000 %, fällig 25.04.2060	175	0,18
	70 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	73	0,08			1.856	1,91
	20 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	20	0,02	Deutschland – 7,40 % (29. Februar 2024: 11,08 %)			
	520 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	570	0,59	EUR	4.110 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	4.021	4,13
	100 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	94	0,10	EUR	790 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	723	0,74
	260 Haleon US Capital LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	240	0,25	EUR	1.850 Deutsche Bundesrepublik Inflationsindexierte Anleihe, Serie iL, 0,500 %, fällig 15.04.2030 β	2.462	2,53
	280 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	281	0,29			7.206	7,40
	70 HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	70	0,07	Indonesien – 1,24 % (29. Februar 2024: 1,22 %)			
	130 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	104	0,11	IDR	17.856.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	1.204	1,24
	50 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	36	0,04	Italien – 1,50 % (29. Februar 2024: 1,13 %)			
	170 Home Depot Inc/The, 4,950 %, fällig 15.09.2052	160	0,16	EUR	1.570 Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	1.462	1,50

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)					
Japan – 10,47 % (29. Februar 2024: 1,76 %)					
JPY 278.800	Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Serie 169, 0,500 %, fällig 20.03.2029	1,820	1,87		
JPY 273.450	Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Serie 170, 0,600 %, fällig 20.06.2029	1,788	1,84		
JPY 293.500	Japanische 10-jährige Staatsanleihe, Serie 375, 1,100 %, fällig 20.06.2034	1,914	1,96		
JPY 14.850	Japanische 30-jährige Staatsanleihe, Series 59, 0,700 %, fällig 20.06.2048	73	0,07		
JPY 335.850	Japanische 30-jährige Staatsanleihe, Series 66, 0,400 %, fällig 20.03.2050	1,459	1,50		
JPY 168.600	Japanische 20-jährige Staatsanleihe, Serie 149, 1,500 %, fällig 20.06.2034	1,138	1,17		
JPY 302.950	Japanische 2-jährige Staatsanleihe, Serie 462, 0,400 %, fällig 01.07.2026	2,004	2,06		
		10,196	10,47		
Mexiko – 2,44 % (29. Februar 2024: 3,98 %)					
MXN 47.600	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	1,896	1,95		
EUR 590	Internationale Staatsanleihe Mexiko, 2,875 %, fällig 08.04.2039	477	0,49		
		2,373	2,44		
Niederlande – 0,85 % (29. Februar 2024: 0,63 %)					
EUR 970	BNG Bank NV, 0,010 %, fällig 05.10.2032	825	0,85		
Norwegen – 1,67 % (29. Februar 2024: 1,02 %)					
NOK 2.420	Norwegische Staatsanleihe, Series 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	193	0,20		
NOK 11.880	Norwegische Staatsanleihe, Serie 486, 144A, 3,000 %, fällig 15.08.2033	996	1,02		
NOK 5.010	Norwegische Staatsanleihe, Serie 487, 144A, 3,625 %, fällig 13.04.2034	439	0,45		
		1,628	1,67		
Polen – 1,67 % (29. Februar 2024: 1,44 %)					
PLN 8.450	Republik Polen, Staatsanleihe, Series 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1,626	1,67		
Südafrika – 1,81 % (29. Februar 2024: 1,36 %)					
ZAR 50.302	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1,761	1,81		
Südkorea – 1,76 % (29. Februar 2024: 1,42 %)					
KRW 2.533.840	Koreanische Schatzanleihe, Series 2606, 1,875 %, fällig 10.06.2026	1,716	1,76		
Spanien – 0,66 % (29. Februar 2024: 0,55 %)					
EUR 190	Spanische Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2044	241	0,25		
EUR 450	Spanische Staatsanleihe, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	400	0,41		
		641	0,66		
Vereinigtes Königreich – 5,04 % (29. Februar 2024: 5,04 %)					
GBP 2.340	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	2,944	3,03		
GBP 1.350	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	1,589	1,63		
GBP 510	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	371	0,38		
		4,904	5,04		
USA – 4,14 % (29. Februar 2024: 19,71 %)					
1.500	United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 31.08.2025	1,505	1,55		
2.460	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 31.05.2029	2,507	2,58		
20	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.11.2047	15	0,01		
		4,027	4,14		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 54.822 \$)					
		48,103	49,42		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 9,18 % (29. Februar 2024: 9,19 %)					
498	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Class LM	7,610	7,82		
9	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	1,322	1,36		
		8,932	9,18		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 8.388 \$)					
		8,932	9,18		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 106.254 \$)					
		97,159	99,82		
Devisenterminkontrakte – 0,28 % (29. Februar 2024: 0,42 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	276	0,28		
Futures – 0,45 % (29. Februar 2024: 0,04 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	434	0,45		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		97,869	100,55		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,10 % (29. Februar 2024: 0,32 %)					
	-100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	-96	-0,10		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -94 \$)					
		-96	-0,10		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert leerverkauften Anlagen (Anschaffungskosten -94 \$)					
		-96	-0,10		
Devisenterminkontrakte – -0,98 % (29. Februar 2024: -0,29 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-954	-0,98		
Futures – -0,27 % (29. Februar 2024: -0,18 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-263	-0,27		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		-1,313	-1,35		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		96,556	99,20		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte					
		775	0,80		
Gesamt Nettovermögen					
		97,331 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.627.000 \$ und machten 7,83 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.				
±	Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 28. Februar 2025 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 28. Februar 2025.				
ABKÜRZUNGEN:					
TBA	– To be announced				
AUD	– Australischer Dollar				
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				
Verteilung des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					81,19
Organismen für gemeinsame Anlagen					8,22
Derivative Finanzinstrumente					0,65
Sonstige Vermögenswerte					9,94
Gesamtvermögen					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 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2025	Citi	Kauf USD 4.686	Verkauf CNH 33.820	\$ 47
13. März 2025	Goldman Sachs	Kauf USD 441	Verkauf BRL 2.610	-1
13. März 2025	Goldman Sachs	Kauf USD 547	Verkauf BRL 3.170	10
13. März 2025	Goldman Sachs	Kauf USD 1.845	Verkauf CNH 13.250	27
13. März 2025	Goldman Sachs	Kauf BRL 5.520	Verkauf USD 895	40
13. März 2025	JP Morgan	Kauf USD 1.313	Verkauf CNH 9.440	18
13. März 2025	JP Morgan	Kauf USD 1.829	Verkauf KRW 2.554.455	81
13. März 2025	JP Morgan	Kauf CNH 700	Verkauf USD 97	-1
14. März 2025	BNY	Kauf USD 2	Verkauf GBP 2	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 216	Verkauf USD 223	1
14. März 2025	BNY	Kauf CAD 102.225	Verkauf USD 71.472	-775
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 2	Verkauf USD 2	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
13. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf USD 25.440	Verkauf EUR 24.440	-13
13. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf USD 1.621	Verkauf PLN 6.580	-1
13. Mai 2025	Citi	Kauf USD 194	Verkauf EUR 184	2
13. Mai 2025	Citi	Kauf USD 8.709	Verkauf GBP 6.949	-30
13. Mai 2025	Citi	Kauf USD 573	Verkauf JPY 84.910	4
13. Mai 2025	Citi	Kauf USD 574	Verkauf NOK 6.438	3
13. Mai 2025	Citi	Kauf EUR 1.032	Verkauf SEK 11.780	-24
13. Mai 2025	Citi	Kauf SEK 11.780	Verkauf USD 1.085	14
13. Mai 2025	Citi	Kauf GBP 91	Verkauf USD 115	–
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf EUR 260	Verkauf USD 268	3
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf JPY 14.736	Verkauf USD 97	2
13. Mai 2025	JP Morgan	Kauf USD 1.692	Verkauf CAD 2.423	12
13. Mai 2025	JP Morgan	Kauf USD 1.293	Verkauf MXN 26.806	2
13. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf USD 2.075	Verkauf AUD 3.340	1
13. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf MXN 7.007	Verkauf USD 339	-2
13. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf USD 661	Verkauf ZAR 12.454	-1
13. Mai 2025	Royal Bank of Canada	Kauf USD 9.031	Verkauf JPY 1.363.444	-104
13. Mai 2025	UBS	Kauf USD 3.923	Verkauf CNH 28.430	9
13. Mai 2025	UBS	Kauf GBP 234	Verkauf USD 296	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 542 \$)				\$ 276
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -371 \$)				-954
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 171 \$)				\$ -678

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Australia 10 Year Bond März 2025	Bank of America Merrill Lynch	14	\$ 986	\$ -10
Euro-Bobl März 2025	Bank of America Merrill Lynch	31	3.792	15
Euro-BTP März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-21	-2.627	41
Euro-Bund März 2025	Bank of America Merrill Lynch	27	3.730	-91
Euro-OAT März 2025	Bank of America Merrill Lynch	8	1.034	-13
Euro-Schatz März 2025	Bank of America Merrill Lynch	51	5.657	-26
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-4	-3.714	67
Long Gilt Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	8	940	9
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	32	3.555	47
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-45	-5.141	-123
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	136	28.148	141
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	45	4.857	39
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	13	1.535	38
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	11	1.365	37
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 52 \$)				\$ 434
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -230 \$)				-263
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -178 \$)				\$ 171

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

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 – 87,99 % (29. Februar 2024: 91,86 %)				Japan – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Australien – 0,73 % (29. Februar 2024: 0,51 %)				Luxemburg – 2,06 % (29. Februar 2024: 3,80 %)			
EUR	100 Ausgrid Finance Pty Ltd, 3,510 %, fällig 14.02.2033	105	0,39	EUR	100 Nippon Life Insurance Co, 4,114 %, fällig 23.01.2055 *	105	0,39
	90 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	92	0,34				
		197	0,73				
Belgien – 1,84 % (29. Februar 2024: 0,35 %)							
EUR	170 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,950 %, fällig 22.03.2044	180	0,67	GBP	100 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig 20.10.2028	115	0,42
EUR	100 Elia Transmission Belgium SA, 3,750 %, fällig 16.01.2036	106	0,39			206	0,76
EUR	100 Shurgard Luxembourg Sarl, 3,625 %, fällig 22.10.2034	105	0,38	EUR	190 P3 Group Sarl, 4,625 %, fällig 13.02.2030		
EUR	100 UCB SA, 4,250 %, fällig 20.03.2030	108	0,40	EUR	120 Prologis International Funding II SA, 4,375 %, fällig 01.07.2036	132	0,49
		499	1,84	EUR	100 SELP Finance Sarl, 3,750 %, fällig 16.01.2032	106	0,39
						559	2,06
Brasilien – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,21 %)				Niederlande – 3,63 % (29. Februar 2024: 3,01 %)			
	60 Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	65	0,24	EUR	200 ABN AMRO Bank NV, 3,875 %, fällig 15.01.2032	215	0,79
Kanada – 0,74 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				EUR	100 Amvest RCF Custodian BV, 3,875 %, fällig 25.03.2030	106	0,39
	200 Bank of Montreal, 7,300 %, fällig 26.11.2084 *	202	0,74	EUR	100 Cooperative Rabobank UA, 3,822 %, fällig 26.07.2034	108	0,40
Kolumbien – 0,29 % (29. Februar 2024: 0,41 %)				EUR	100 CTP NV, 3,875 %, fällig 21.11.2032	104	0,38
	110 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	79	0,29	EUR	130 Enxsis Holding NV, 3,625 %, fällig 12.06.2034	141	0,52
Dänemark – 2,57 % (29. Februar 2024: 1,57 %)				EUR	100 ING Groep NV, 3,375 %, fällig 19.11.2032 *	104	0,39
EUR	150 Carlsberg Breweries A/S, 3,250 %, fällig 28.02.2032	157	0,57	EUR	100 Koninklijke Ahold Delhaize NV, 1,750 %, fällig 02.04.2027	102	0,38
EUR	190 Danske Bank A/S, 4,750 %, fällig 21.06.2030 *	211	0,78	EUR	100 Stedin Holding NV, 3,375 %, fällig 12.02.2037	104	0,38
EUR	120 Danske Bank A/S, 4,625 %, fällig 14.05.2034 *	130	0,48			984	3,63
	200 Danske Bank A/S, 7,000 %, Ewige Anleihe *	200	0,74	Portugal – 1,17 % (29. Februar 2024: 1,01 %)			
		698	2,57	EUR	100 EDP SA, 1,875 %, fällig 02.08.2081 *	102	0,38
Finnland – 0,94 % (29. Februar 2024: 1,45 %)				EUR	100 EDP Servicios Financieros Espana SA, 3,500 %, fällig 21.07.2031	106	0,39
EUR	130 Fortum Oyj, 1,625 %, fällig 27.02.2026	134	0,49	EUR	100 Floene Energias SA, 4,875 %, fällig 03.07.2028	109	0,40
EUR	110 Nordea Bank Abp, 4,875 %, fällig 23.02.2034 *	120	0,45			317	1,17
		254	0,94	Südafrika – 0,60 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Frankreich – 8,71 % (29. Februar 2024: 9,44 %)				EUR	150 Anglo American Capital Plc, 4,125 %, fällig 15.03.2032	162	0,60
EUR	100 Aeroports de Paris SA, 3,375 %, fällig 16.05.2031	106	0,39	Spanien – 3,47 % (29. Februar 2024: 2,73 %)			
EUR	100 Air France-KLM, 4,625 %, fällig 23.05.2029	107	0,39	EUR	100 Aena SME SA, 4,250 %, fällig 13.10.2030	110	0,41
EUR	200 BNP Paribas SA, 4,199 %, fällig 16.07.2035 *	212	0,78		200 Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	203	0,75
	200 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	208	0,77	EUR	200 Banco Santander SA, 3,500 %, fällig 17.02.2035	207	0,76
EUR	100 BPCE SA, 3,875 %, fällig 26.02.2036 *	105	0,39	GBP	100 CaixaBank SA, 6,875 %, fällig 25.10.2033 *	131	0,48
EUR	100 Credit Agricole SA, 3,500 %, fällig 26.09.2034	103	0,38	EUR	100 CaixaBank SA, 4,000 %, fällig 05.03.2037 *	104	0,38
EUR	100 Credit Agricole SA, 4,125 %, fällig 26.02.2036	108	0,40	EUR	200 Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.02.2033	186	0,69
EUR	100 Credit Agricole SA, 5,875 %, Ewige Anleihe *	105	0,39			941	3,47
EUR	200 Eiffage SA, 1,625 %, fällig 14.01.2027	202	0,75	Schweden – 0,89 % (29. Februar 2024: 2,44 %)			
EUR	200 Electricite de France SA, 1,000 %, fällig 29.11.2033	171	0,63	EUR	140 H&M Finance BV, 0,250 %, fällig 25.08.2029	130	0,48
EUR	100 Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	91	0,33	EUR	100 Telefonaktiebolaget LM Ericsson, 5,375 %, fällig 29.05.2028	111	0,41
EUR	100 Engie SA, 4,250 %, fällig 11.01.2043	107	0,39			241	0,89
EUR	100 ITM Entreprises SASU, Series 0, 4,125 %, fällig 29.01.2030	105	0,39	Schweiz – 1,86 % (29. Februar 2024: 1,43 %)			
EUR	100 Roquette Freres SA, 3,774 %, fällig 25.11.2031	104	0,38	GBP	200 UBS Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *	237	0,88
EUR	100 RTE Réseau de Transport d'Electricite SADIR, 3,750 %, fällig 30.04.2044	105	0,39	EUR	260 UBS Group AG, 3,250 %, fällig 12.02.2034 *	267	0,98
EUR	100 Suez SACA, 1,875 %, fällig 24.05.2027	102	0,37			504	1,86
EUR	200 Thales SA, 4,125 %, fällig 18.10.2028	217	0,80	Vereinigtes Königreich – 10,47 % (29. Februar 2024: 14,54 %)			
EUR	100 Unibail-Rodamco-Westfield SE, 3,875 %, fällig 11.09.2034	105	0,39	GBP	120 CPUK Finance Ltd, 5,940 %, fällig 28.08.2030	155	0,57
		2.363	8,71	EUR	150 Gatwick Funding Ltd, 3,625 %, fällig 16.10.2033	157	0,58
Deutschland – 5,59 % (29. Februar 2024: 8,31 %)					200 HSBC Holdings Plc, 2,357 %, fällig 18.08.2031 *	174	0,64
	200 Allianz SE, 3,200 %, Ewige Anleihe *	178	0,65	GBP	100 J Sainsbury Plc, 5,625 %, fällig 29.01.2035	126	0,46
EUR	100 Amprion GmbH, 3,971 %, fällig 22.09.2032	108	0,40	EUR	410 Lloyds Banking Group Plc, 3,625 %, fällig 04.03.2036 *	425	1,57
EUR	100 Deutsche Bahn Finance GmbH, 4,000 %, fällig 23.11.2043	112	0,41	GBP	200 Marston's Issuer Plc, Series B1, 7,228 %, fällig 16.07.2035 *	217	0,80
	140 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	164	0,61			340	1,25
EUR	100 EnBW International Finance BV, 4,300 %, fällig 23.05.2034	111	0,41	GBP	290 NatWest Group Plc, 4,500 %, Ewige Anleihe *	108	0,40
EUR	100 Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *	94	0,35	EUR	100 RELX Finance BV, 3,750 %, fällig 12.06.2031	104	0,38
EUR	100 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	104	0,38	EUR	100 Segro Plc, 3,500 %, fällig 24.09.2032	108	0,40
EUR	100 Sirius Real Estate Ltd, 1,750 %, fällig 24.11.2028	98	0,36	EUR	100 Severn Trent Utilities Finance Plc, 3,875 %, fällig 04.08.2035	106	0,39
EUR	100 Sirius Real Estate Ltd, 4,000 %, fällig 22.01.2032	104	0,38	EUR	110 Southern Gas Networks Plc, 3,500 %, fällig 16.10.2030	115	0,43
EUR	100 TAG Immobilien AG, 4,250 %, fällig 04.03.2030	107	0,39	EUR	170 SSE Plc, 4,000 %, Ewige Anleihe *	178	0,66
EUR	100 Vier Gas Transport GmbH, 4,625 %, fällig 26.09.2032	113	0,42	EUR	120 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 4,250 %, fällig 27.02.2031	132	0,49
GBP	100 Volkswagen Financial Services NV, 4,250 %, fällig 09.10.2025	125	0,46	EUR	130 Tritax EuroBox Plc, 0,950 %, fällig 02.06.2026	131	0,48
EUR	100 ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	99	0,37	GBP	100 Vodafone Group Plc, 8,000 %, fällig 30.08.2086 *	137	0,50
		1.517	5,59	GBP	100 Whitbread Group Plc, 3,000 %, fällig 31.05.2031	110	0,41
				GBP	100 Whitbread Group Plc, 5,500 %, fällig 31.05.2032	126	0,46
						2.841	10,47
Irland – 0,71 % (29. Februar 2024: 0,60 %)				USA – 38,02 % (29. Februar 2024: 34,82 %)			
	240 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041	194	0,71	110 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	104	0,38	
Israel – 0,57 % (29. Februar 2024: 0,50 %)				200 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	187	0,69	
EUR	130 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig 15.09.2029	155	0,57	60 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	61	0,22	
Italien – 2,50 % (29. Februar 2024: 4,06 %)				170 Air Lease Corp, 3,700 %, fällig 15.04.2030	180	0,66	
EUR	100 Enel Finance International NV, 3,500 %, fällig 24.02.2036	104	0,38	25 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	25	0,09	
	200 Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, fällig 14.10.2052	244	0,90	150 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	149	0,55	
EUR	100 Esercizi Aeroportuali SEA SpA, 3,500 %, fällig 22.01.2032	105	0,39	80 American Express Co, 5,085 %, fällig 30.01.2031 *	81	0,30	
EUR	200 Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, Ewige Anleihe *	226	0,83	50 Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	50	0,18	
		679	2,50				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)									
EUR	80	Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030	79	0,29	EUR	30	RTX Corp, 6,000 %, fällig 15.03.2031	32	0,12
	50	Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	32	0,12		30	RTX Corp, 6,100 %, fällig 15.03.2034	32	0,12
	60	Arthur J Gallagher & Co, 5,150 %, fällig 15.02.2035	60	0,22		100	Schneider Electric SE, 3,375 %, fällig 03.09.2036	105	0,39
	30	Athene Holding Ltd, 6,250 %, fällig 01.04.2054	31	0,11		120	Service Corp International/US, 3,375 %, fällig 15.08.2030	108	0,40
	290	Bank of America Corp, 1,662 %, fällig 25.04.2028 *	295	1,09		90	Solventum Corp, 5,600 %, fällig 23.03.2034	92	0,34
	80	Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 *	81	0,30		80	Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	81	0,30
	160	Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	115	0,42		40	Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	37	0,14
	90	Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200 %, fällig 15.08.2048	76	0,28		90	Targa Resources Corp, 6,500 %, fällig 30.03.2034	97	0,36
	17	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	16	0,06		40	Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	34	0,13
	50	Broadcom Inc, 4,300 %, fällig 15.11.2032	48	0,18		130	Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	116	0,43
140	Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	141	0,52	100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	106	0,39		
100	Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	96	0,35	170	T-Mobile USA Inc, 3,850 %, fällig 08.05.2036	181	0,67		
180	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	127	0,47	12	United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	12	0,04		
20	Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	20	0,07	80	United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	81	0,30		
140	Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	125	0,46	130	UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	111	0,41		
220	Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	152	0,56	130	Verizon Communications Inc, 4,250 %, fällig 31.10.2030	143	0,53		
100	Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	103	0,38	50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	50	0,19		
180	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	226	0,83	120	VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2030	113	0,42		
40	Coca-Cola Co/The, 5,200 %, fällig 14.01.2055	39	0,14	210	Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02.02.2027	211	0,78		
70	Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	62	0,23	90	Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034 *	91	0,34		
80	Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	81	0,30	60	Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	55	0,20		
EUR	110	CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, fällig 11.07.2031	120	0,44	130	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	115	0,42	
	60	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	52	0,19	50	Williams Cos Inc/The, 5,300 %, fällig 15.08.2028	51	0,19	
	70	DCP Midstream Operating LP, 5,625 %, fällig 15.07.2027	71	0,26	90	Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24.06.2044	90	0,33	
	38	Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	37	0,14	20	Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	14	0,05	
	130	Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	113	0,41			10.312	38,02	
	100	Diamondback Energy Inc, 5,750 %, fällig 18.04.2054	97	0,36	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 24.919 \$)			23.868	87,99
	140	Energy Transfer LP, 5,200 %, fällig 01.04.2030	142	0,52	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 6,37 % (29. Februar 2024: 2,53 %)				
	160	Energy Transfer LP, 5,600 %, fällig 01.09.2034	162	0,60	Deutschland – 2,71 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
	130	Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	128	0,47	EUR	170	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	159	0,59
	40	Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	40	0,15	EUR	110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	99	0,36
100	Expand Energy Corp, 5,375 %, fällig 15.03.2030	99	0,37	EUR	420	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032	375	1,38	
30	FirstEnergy Transmission LLC, 5,000 %, fällig 15.01.2035	30	0,11	EUR	130	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.05.2036	103	0,38	
50	Florida Power & Light Co, 5,300 %, fällig 15.06.2034	51	0,19			736	2,71		
30	Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	26	0,09	Indonesien – 0,50 % (29. Februar 2024: 1,03 %)					
180	Ford Motor Credit Co LLC, 2,386 %, fällig 17.02.2026	186	0,68	EUR	150	Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 1,400 %, fällig 30.10.2031	136	0,50	
100	General Electric Co, 4,125 %, fällig 19.09.2035	110	0,41	Israel – 0,74 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
130	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	136	0,50	200	Israel, Internationale Staatsanleihe, Series 5Y, 5,375 %, fällig 19.02.2030	202	0,74		
16	Goldman Sachs Capital II, 5,348 %, Ewige Anleihe *	14	0,05	Mexiko – 0,67 % (29. Februar 2024: 1,12 %)					
110	Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	105	0,39	220	Internationale Staatsanleihe Mexiko, 3,500 %, fällig 12.02.2034	181	0,67		
20	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	19	0,07	Vereinigtes Königreich – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
40	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,850 %, Ewige Anleihe *	41	0,15	GBP	40	United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 31.07.2035	34	0,13	
70	Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	64	0,24	USA – 1,62 % (29. Februar 2024: 0,38 %)					
130	HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	121	0,45	150	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 31.12.2026	151	0,56		
50	HEICO Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2028	51	0,19	200	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 30.11.2029	201	0,74		
20	HEICO Corp, 5,350 %, fällig 01.08.2033	20	0,07	20	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	20	0,07		
110	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.04.2029	111	0,41	70	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	67	0,25		
20	Intercontinental Exchange Inc, 4,250 %, fällig 21.09.2048	17	0,06			439	1,62		
210	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	211	0,78	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.809 \$)				1.728	6,37
500	JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, fällig 24.02.2028 *	497	1,83	Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,13 % (29. Februar 2024: 0,22 %)					
170	JPMorgan Chase & Co, 3,588 %, fällig 23.01.2036 *	178	0,66	1.392 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)				1.392	5,13
30	Kroger Co/The, 5,500 %, fällig 15.09.2054	29	0,11	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.392 \$)				1.392	5,13
30	Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	19	0,07	Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,27 %)					
180	Marsh & McLennan Cos Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2035	179	0,66	Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,27 %)					
240	McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	237	0,87	680	Credit Suisse Group AG Escrow T=0	–	–		
150	Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	103	0,38	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)				–	–
340	Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029 *	371	1,37	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 28.120 \$)				26.988	99,49
20	Morgan Stanley, 5,587 %, fällig 18.01.2036 *	21	0,08	Devisenterminkontrakte – 0,15 % (29. Februar 2024: 0,29 %)					
50	Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	51	0,19	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				41	0,15
100	MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	89	0,33						
230	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	246	0,91						
30	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 6,950 %, fällig 15.09.2026	31	0,11						
60	NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02.12.2027	56	0,21						
50	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	49	0,18						
90	Occidental Petroleum Corp, 5,375 %, fällig 01.01.2032	89	0,33						
55	Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	58	0,21						
30	Pacific Gas and Electric Co, 5,700 %, fällig 01.03.2035	30	0,11						
160	Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2032	165	0,61						
50	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	50	0,18						
110	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, fällig 19.05.2053	106	0,39						
120	Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	92	0,34						
100	Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	96	0,35						
100	Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, fällig 15.03.2028	96	0,35						

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Futures – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,27 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	107	0,39
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	27.136	100,03
Credit Default Swaps – 0,44 % (29. Februar 2024: 0,61 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-119	-0,44
Devisenterminkontrakte – -0,08 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-21	-0,08
Futures – -0,05 % (29. Februar 2024: -0,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-14	-0,05
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-154	-0,57
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	26.982	99,46
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	144	0,54
Gesamtvermögen	27.126 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.704.000 \$ und machten 6,28 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.
- † 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

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,63
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,93
Derivative Finanzinstrumente	0,52
Sonstige Vermögenswerte	3,92
Gesamtvermögen	100,00

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.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2029	1.540	\$ -33
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2029	701	-64
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2029	1.020	-22
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -188 \$)				-119
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -188 \$)				\$ -119

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	1	\$ –
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	1	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	72	Verkauf	USD	76	-1
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	4.753	Verkauf	USD	4.911	23
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	1	Verkauf	USD	1	–
13. Mai 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	192	Verkauf	EUR	183	1
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD	384	Verkauf	EUR	370	-2
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD	343	Verkauf	EUR	326	4
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD	3.144	Verkauf	GBP	2.510	-12
13. Mai 2025	Citi	Kauf	USD	23	Verkauf	GBP	18	–
13. Mai 2025	Citi	Kauf	EUR	510	Verkauf	USD	537	-6
13. Mai 2025	Citi	Kauf	GBP	964	Verkauf	USD	1.199	13
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD	41	Verkauf	EUR	39	–
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR	73	Verkauf	USD	76	–
13. Mai 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR	61	Verkauf	USD	63	–
13. Mai 2025	HSBC	Kauf	USD	26	Verkauf	JPY	3.908	–
13. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	USD	5	Verkauf	CAD	7	–
13. Mai 2025	UBS	Kauf	USD	13.637	Verkauf	EUR	13.095	–
13. Mai 2025	UBS	Kauf	EUR	538	Verkauf	USD	561	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 90 \$)								\$ 41
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1 \$)								-21
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 89 \$)								\$ 20

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-22	\$ -2.691	\$ 2
Euro-Bund März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-26	-3.592	13
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2025	Bank of America Merrill Lynch	1	135	-12
Euro-Schatz März 2025	Bank of America Merrill Lynch	-5	-555	2
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	18	2.000	27
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	11	1.257	25
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	13	2.690	14
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	2	216	1
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-1	-118	-2
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	7	869	23
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 82 \$)				\$ 107
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -21 \$)				-14
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 61 \$)				\$ 93

[^] 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 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 12,30 % (29. Februar 2024: 11,37 %)					
470 1988 CLO 5 Ltd, Series 2024 5A, Class D1, 144A, 7,602 %, fällig 15.07.2037 *	480	0,12	450 HPS Loan Management 2024-20 Ltd, Series 2024 20A, Class D2, 144A, 8,800 %, fällig 25.07.2037 *	459	0,11
500 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 7,914 %, fällig 15.04.2034 *	502	0,12	750 Katayma CLO I Ltd, Series 2023 1A, Class D, 144A, 9,543 %, fällig 20.10.2036 *	772	0,19
250 AB BSL CLO 4 Ltd, Series 2023 4A, Class A, 144A, 6,293 %, fällig 20.04.2036 *	251	0,06	187 Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse B, 144A, 3,450 %, fällig 20.12.2047	156	0,04
57 ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1, Class A3, 5,114 %, fällig 25.04.2033 *	55	0,02	180 Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M4, 5,709 %, fällig 25.02.2035 *	176	0,04
1.274 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3, Series 2005 HE3, Class M4, 5,379 %, fällig 25.05.2035 *	1.153	0,28	1.000 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,244 %, fällig 15.10.2031 *	1.005	0,25
493 Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Ctf's Ser 2005-4, Series 2005 4, Class M2, 5,139 %, fällig 25.10.2035 *	468	0,12	1.270 Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 8,085 %, fällig 20.01.2032 *	1.277	0,31
950 AGL CLO 12 Ltd, Series 2021 12A, Class D, 144A, 7,405 %, fällig 20.07.2034 *	956	0,23	465 Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Series 2007 HE2, Class A1, 5,584 %, fällig 25.08.2037 *	403	0,10
230 AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 7,203 %, fällig 17.07.2037 *	233	0,06	1.050 Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Series 2022 1A, Class B, 144A, 3,160 %, fällig 20.01.2053	813	0,20
460 Apex Credit CLO 2020 Ltd, Series 2020 1A, Class DRR, 144A, 8,613 %, fällig 20.04.2035 *	462	0,11	990 Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 1A, Class DR, 144A, 7,893 %, fällig 26.08.2034 *	997	0,25
600 Apidos CLO XXX XXXA, Class CR, 144A, 7,293 %, fällig 18.10.2031 *	603	0,15	710 National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	39	0,01
320 Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class D, 144A, 7,500 %, fällig 25.04.2035 *	322	0,08	314 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class B, 4,814 %, fällig 26.03.2035 *	286	0,07
890 Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class E, 144A, 10,050 %, fällig 25.04.2035 *	903	0,22	35 National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Series 2006 1, Class A5, 4,784 %, fällig 25.03.2033 *	34	0,01
700 Bain Capital Credit CLO 2019-1, Series 2019 1A, Class DR2, 144A, 7,393 %, fällig 19.04.2034 *	704	0,17	790 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 4,794 %, fällig 26.01.2032 *	682	0,17
1.180 Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class DRR, 144A, 7,390 %, fällig 23.10.2034 *	1.185	0,29	444 National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Series 2007 2, Class A4, 4,724 %, fällig 25.01.2033 *	430	0,11
480 Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Series 2022 2A, Class D1, 144A, 7,940 %, fällig 22.04.2035 *	482	0,12	1.299 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	212	0,05
660 Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class AN, 144A, 6,138 %, fällig 16.04.2036 *	662	0,16	440 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 55 Ltd, Series 2024 55A, Class D1, 144A, 7,790 %, fällig 22.04.2038 *	449	0,11
1.380 Ballyrock CLO 19 Ltd, Series 2022 19A, Class D, 144A, 11,403 %, fällig 20.04.2035 *	1.387	0,34	570 Neuberger Berman Loan Advisers Clo 56 Ltd, Series 2024 56A, Class E, 144A, 10,047 %, fällig 24.07.2037 *	580	0,14
1.225 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 7,705 %, fällig 20.04.2031 *	1.232	0,30	1.000 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 8,001 %, fällig 13.10.2031 *	1.006	0,25
175 Ballyrock CLO 26 Ltd, Series 2024 26A, Class D, 144A, 10,400 %, fällig 25.07.2037 *	180	0,04	800 Ocean Trails CLO X, Series 2020 10A, Class ER, 144A, 12,134 %, fällig 15.10.2034 *	800	0,20
875 Barings Private Credit Corp CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class CR, 144A, 8,802 %, fällig 15.10.2036 *	904	0,22	370 Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class D1R, 144A, 7,793 %, fällig 20.07.2035 *	371	0,09
256 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 2,813 %, fällig 25.09.2034 *	252	0,06	750 Ocp Clo 2024-33 Ltd, Series 2024 33A, Class E, 144A, 10,293 %, fällig 20.07.2037 *	765	0,19
520 Birch Grove CLO 6 Ltd, Series 2023 6A, Class D, 144A, 10,123 %, fällig 20.07.2035 *	532	0,13	650 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 7,155 %, fällig 20.01.2031 *	652	0,16
540 BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1, 144A, 5,644 %, fällig 15.07.2031 *	542	0,13	470 OHA Credit Funding 11 Ltd, Series 2022 11A, Class D1R, 144A, 7,143 %, fällig 19.07.2037 *	475	0,12
380 Captree Park CLO Ltd, Series 2024 1A, Class D, 144A, 7,543 %, fällig 20.07.2037 *	387	0,09	310 OHA Credit Funding 14 Ltd, Series 2023 14A, Class D, 144A, 9,043 %, fällig 20.04.2036 *	313	0,08
500 Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,693 %, fällig 20.07.2037 *	510	0,13	560 OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class D1, 144A, 7,743 %, fällig 20.04.2037 *	570	0,14
950 CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class D1, 144A, 7,571 %, fällig 20.10.2037 *	959	0,24	500 OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D1, 144A, 7,193 %, fällig 20.07.2037 *	508	0,12
11 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, Series 2005 D, Class 2A, 4,616 %, fällig 15.11.2035 *	10	–	940 Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M4, 5,364 %, fällig 25.08.2035 *	796	0,20
600 Empower CLO 2023-3 Ltd, Series 2023 3A, Class D1, 144A, 9,443 %, fällig 20.01.2037 *	619	0,15	820 Palmer Square CLO 2022-3 Ltd, Series 2022 3A, Class D1R, 144A, 7,243 %, fällig 20.07.2037 *	838	0,21
660 Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M4, 5,364 %, fällig 25.11.2035 *	624	0,15	270 Pikes Peak CLO 6, Series 2020 6A, Class ERR, 144A, –, fällig 18.05.2034 *	271	0,07
1.000 Flatiron CLO 28 Ltd, Series 2024 1A, Class D1, 144A, 7,302 %, fällig 15.07.2036 *	1.007	0,25	469 RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3, Class M1, 4,944 %, fällig 25.03.2036 *	459	0,11
1.260 GoldenTree Loan Management US CLO 16 Ltd, Series 2022 16A, Class DRR, 144A, 6,716 %, fällig 20.01.2038 *	1.263	0,31	320 SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Serie 2015 C, Klasse C, 144A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	313	0,08
750 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class E, 144A, 11,255 %, fällig 20.07.2034 *	750	0,18	735 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,690 %, fällig 23.07.2037 *	742	0,18
750 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class ER, 144A, 0,000 %, fällig 20.07.2034 *	754	0,19	500 Trinitas CLO XXV Ltd, Series 2023 25A, Class C1, 144A, 7,540 %, fällig 23.01.2037 *	508	0,13
580 Golub Capital Partners CLO 60B Ltd, Series 2022 60A, Class DR, 144A, 7,260 %, fällig 25.10.2034 *	582	0,14	470 Trinitas CLO XXVII Ltd, Series 2024 27A, Class D1, 144A, 8,593 %, fällig 18.04.2037 *	482	0,12
300 Golub Capital Partners CLO 66B Ltd, Series 2023 66A, Class A, 144A, 6,250 %, fällig 25.04.2036 *	301	0,07	650 Valley Stream Park CLO Ltd, Series 2022 1A, Class DRR, 144A, 6,993 %, fällig 20.01.2037 *	648	0,16
420 Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 7,500 %, fällig 25.07.2037 *	429	0,11	561 WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4, Class 1A, 4,604 %, fällig 25.07.2047 *	417	0,10
370 Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class D1, 144A, 7,642 %, fällig 25.10.2037 *	373	0,09	950 Warwick Capital CLO 1 Ltd, Series 2023 1A, Class D, 144A, 9,893 %, fällig 20.10.2036 *	958	0,24
250 Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class E, 144A, 10,492 %, fällig 25.10.2037 *	257	0,06	800 Warwick Capital CLO 3 Ltd, Series 2024 3A, Class D, 144A, 8,793 %, fällig 20.04.2037 *	818	0,20
1.107 Goto Foods Funding LLC, Series 2017 1A, Class A2II, 144A, 5,093 %, fällig 30.04.2047	1.100	0,27	750 Wellington Management Clo 2 Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 8,193 %, fällig 20.04.2037 *	765	0,19
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 9,514 %, fällig 15.04.2031 *	252	0,06	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 50.124 \$)		12,30
1.700 Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 10,955 %, fällig 20.04.2034 *	1.714	0,42	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 17,56 % (29. Februar 2024: 14,39 %)		
400 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, Series 2005 C, Class M2, 5,184 %, fällig 25.10.2035 *	395	0,10	1.000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class D, 144A, 6,147 %, fällig 15.09.2034 *	976	0,24
44 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-D, Series 2005 D, Class AII4, 5,134 %, fällig 25.03.2036 *	44	0,01	243 Alternative Loan Trust 2007-4CB, Serie 2007 4CB, Klasse 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	202	0,05

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)							
1.430	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A4, 3,175 %, fällig 15.09.2060	1.382	0,34	75	Fannie Mae Pool 'CB3880', 5,000 %, fällig 06.01.2052	75	0,02
1.060	BANK 2017-BNK7, Serie 2017 BNK7, Klasse A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	1.026	0,25	2.643	Fannie Mae Pool 'FA0024', 2,000 %, fällig 08.01.2042	2.286	0,56
500	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Serie 2017 BNK3, Class D, 144A, 3,250 %, fällig 15.02.2050	450	0,11	1.914	Fannie Mae Pool 'FS2463', 3,000 %, fällig 01.02.2052	1.673	0,41
140	BBCCRE Trust 2015-GTP, Serie 2015 GTP, Class D, 144A, 4,563 %, fällig 10.08.2033 *	122	0,03	60	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Serie 2003 FF4, Class M1, 6,223 %, fällig 25.10.2033 *	59	0,01
428	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Class A, 144A, 5,859 %, fällig 15.07.2035 *	428	0,11	1.621	Freddie Mac Pool 'QG1295', 5,500 %, fällig 01.04.2053	1.631	0,40
752	BHMS 2018-ATLS, Serie 2018 ATLS, Class C, 144A, 6,509 %, fällig 15.07.2035 *	749	0,18	479	Freddie Mac Pool „SD5876“, 6,000 %, fällig 05.01.2054	491	0,12
1.100	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust, Serie 2013 1515, Class F, 144A, 3,927 %, fällig 10.03.2033 *	968	0,24	480	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Serie 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	445	0,11
1.030	BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Serie 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041 *	1.030	0,25	873	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Serie 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	848	0,21
760	BX Trust 2021-VIEW, Serie 2021 VIEW, Class C, 144A, 6,776 %, fällig 15.06.2036 *	756	0,19	898	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Serie 2018 2, Class BX, 2,702 %, fällig 25.11.2057 *	339	0,08
91	BXMT 2020-FL2 Ltd, Serie 2020 FL2, Class A, 144A, 5,328 %, fällig 15.02.2038 *	91	0,02	244	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Serie 2018 3, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25.08.2057 *	235	0,06
734	Chase Mortgage Finance Corp, Serie 2016 SH2, Class M4, 144A, 3,750 %, fällig 25.12.2045 *	672	0,17	790	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, Serie 2018 4, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25.03.2058	755	0,19
790	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Serie 2015 GC29, Class B, 3,758 %, fällig 10.04.2048 *	768	0,19	263	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Serie 2021 DNA2, Class M2, 144A, 6,652 %, fällig 25.08.2033 *	272	0,07
650	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC33, Serie 2015 GC33, Class B, 4,574 %, fällig 10.09.2058 *	606	0,15	680	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Serie 2020 DNA6, Class B1, 144A, 7,352 %, fällig 25.12.2050 *	740	0,18
1.109	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Serie 2015 P1, Class D, 144A, 3,225 %, fällig 15.09.2048	1.021	0,25	580	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Serie 2021 DNA3, Class B1, 144A, 7,852 %, fällig 25.10.2033 *	658	0,16
260	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, Serie 2016 C1, Class A4, 3,209 %, fällig 10.05.2049	255	0,06	600	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Serie 2021 DNA5, Class B1, 144A, 7,402 %, fällig 25.01.2034 *	647	0,16
18.150	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Serie 2016 C3, Class XA, 0,913 %, fällig 15.11.2049 *	204	0,05	680	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Serie 2021 DNA6, Class B1, 144A, 7,752 %, fällig 25.10.2041 *	703	0,17
1.400	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	1.358	0,33	710	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Serie 2022 DNA2, Class B1, 144A, 9,102 %, fällig 25.02.2042 *	750	0,18
31.130	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Serie 2017 P8, Class XA, 0,861 %, fällig 15.09.2050 *	509	0,12	900	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Serie 2022 DNA2, Class M2, 144A, 8,102 %, fällig 25.02.2042 *	941	0,23
586	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Serie 2018 C5, Klasse A3, 3,963 %, fällig 10.06.2051	572	0,14	890	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Serie 2022 DNA6, Class M2, 144A, 10,102 %, fällig 25.09.2042 *	984	0,24
626	COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust, Serie 2024 2, Class A3, 144A, 6,429 %, fällig 25.04.2069	631	0,16	900	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2025-DNA1, Serie 2025 DNA1, Class M2, 144A, 5,702 %, fällig 25.01.2045 *	902	0,22
710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Serie 2015 DC1, Class C, 4,290 %, fällig 10.02.2048 *	643	0,16	491	Freddie Mac STACR Securitization Participation Interests Trust 2017-SP11, Serie 2017 SP11, Class B, 144A, 4,110 %, fällig 25.09.2047 *	357	0,09
408	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Serie 2019 R03, Class 1B1, 144A, 8,566 %, fällig 25.09.2031 *	435	0,11	958	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	987	0,24
314	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Class 1B1, 144A, 7,866 %, fällig 25.10.2039 *	325	0,08	1.021	Ginnie Mae II Pool 'MA8347', 4,500 %, fällig 20.10.2052	987	0,24
260	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,716 %, fällig 25.01.2040 *	269	0,07	924	Ginnie Mae II Pool 'MA8570', 5,500 %, fällig 20.01.2053	928	0,23
723	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Class 1B1, 144A, 7,452 %, fällig 25.10.2041 *	743	0,18	750	Greystone CRE Notes 2024-HC3, Serie 2024 HC3, Class D, 144A, 9,644 %, fällig 15.03.2041 *	751	0,18
497	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Class 1M2, 144A, 5,902 %, fällig 25.10.2041 *	499	0,12	590	GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Serie 2017 375H, Class A, 144A, 3,475 %, fällig 10.09.2037 *	560	0,14
190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Serie 2021 R03, Class 1B1, 144A, 7,102 %, fällig 25.12.2041 *	194	0,05	1.250	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Serie 2015 GC30, Class D, 3,384 %, fällig 10.05.2050	986	0,24
700	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Serie 2022 R04, Class 1M2, 144A, 7,452 %, fällig 25.03.2042 *	729	0,18	240	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Klasse D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	228	0,06
1.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02, Serie 2023 R02, Class 1B1, 144A, 9,902 %, fällig 25.01.2043 *	1.107	0,27	48	GSMPs Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Serie 2006 RP1, Klasse 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25.01.2036	43	0,01
250	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Serie 2023 R05, Class 1M2, 144A, 7,453 %, fällig 25.06.2043 *	264	0,06	565	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Class C, 144A, 6,126 %, fällig 16.06.2036 *	563	0,14
760	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Serie 2023 R06, Class 1M2, 144A, 7,052 %, fällig 25.07.2043 *	788	0,19	170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Serie 2021 FL1, Class D, 144A, 6,776 %, fällig 16.06.2036 *	170	0,04
940	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Class 1B1, 144A, 7,052 %, fällig 25.01.2044 *	968	0,24	700	Hilton USA Trust 2016-HHV, Serie 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05.11.2038 *	684	0,17
780	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Serie 2024 R01, Class 1M2, 144A, 6,152 %, fällig 25.01.2044 *	790	0,19	1.052	Impac Secured Assets Trust 2006-3, Serie 2006 3, Class A7, 4,974 %, fällig 25.11.2036 *	905	0,22
1.160	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Serie 2015 C3, Class C, 4,354 %, fällig 15.08.2048 *	1.011	0,25	663	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR10, Serie 2005 AR10, Class A2, 5,014 %, fällig 25.06.2035 *	502	0,12
940	CSAIL 2016-C5 Commercial Mortgage Trust, Serie 2016 C5, Klasse A5, 3,757 %, fällig 15.11.2048	931	0,23	340	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Serie 2016 NINE, Class A, 144A, 2,854 %, fällig 06.09.2038 *	330	0,08
360	CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Serie 2017 C8, Class C, 4,259 %, fällig 15.06.2050 *	314	0,08	900	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Serie 2018 WPT, Class FFL, 144A, 7,452 %, fällig 05.07.2033 *	471	0,12
350	CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust, Serie 2018 CX12, Class C, 4,718 %, fällig 15.08.2051 *	325	0,08	280	JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Serie 2009 10, Class 7A2, 144A, 6,054 %, fällig 26.02.2037 *	125	0,03
1.130	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Class F, 144A, 8,794 %, fällig 15.07.2032 *	1.124	0,28	1.380	MF1 2024-FL16, Serie 2024 FL16, Class A, 144A, 5,853 %, fällig 18.11.2039 *	1.386	0,34
500	CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,794 %, fällig 15.07.2032 *	486	0,12	1.210	MF1 2025-FL17 LLC, Serie 2025 FL17, Class A, 144A, 7,790 %, fällig 18.02.2040 *	1.212	0,30
345	DBGS 2018-BIOD Mortgage Trust, Serie 2018 BIOD, Class D, 144A, 5,908 %, fällig 15.05.2035 *	342	0,08	280	MF1 2025-FL17 LLC, Serie 2025 FL17, Class D, 144A, 5,620 %, fällig 18.02.2040 *	280	0,07
542	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Class 1A1B, 4,568 %, fällig 19.04.2047 *	418	0,10	240	MF1 2025-FL17 LLC, Serie 2025 FL17, Class E, 144A, 7,041 %, fällig 18.02.2040 *	240	0,06
630	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C07, Class 1B1, 8,466 %, fällig 25.05.2030 *	681	0,17	500	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2015-C27, Serie 2015 C27, Klasse A4, 3,753 %, fällig 15.12.2047	496	0,12
950	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Class 1B1, 8,016 %, fällig 25.07.2030 *	1.024	0,25	1.120	Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, Serie 2015 UBS8, Class C, 4,577 %, fällig 15.12.2048 *	1.027	0,25
				381	Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Serie 2018 MP, Class A, 144A, 4,276 %, fällig 11.07.2040 *	349	0,09
				1.293	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2005-2AR, Serie 2005 2AR, Class B1, 4,934 %, fällig 25.04.2035 *	1.015	0,25

^ 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 28. Februar 2025 – (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)			China – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,14 %)		
880 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	571	0,14	600 Country Garden Holdings Company Limited, 0,000 %, fällig 27.01.2026 †	60	0,02
361 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	173	0,04	570 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	489	0,12
995 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class B2, 144A, 4,250 %, fällig 25.09.2056 *	967	0,24		549	0,14
733 OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A3, 144A, 6,455 %, fällig 25.11.2063	740	0,18	Kolumbien – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,25 %)		
800 One Market Plaza Trust 2017-1MKT, Series 2017 1MKT, Class B, 144A, 3,845 %, fällig 10.02.2032	733	0,18	940 Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig 19.01.2036	934	0,23
289 Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Series 2007 2, Class 1A3, 5,066 %, fällig 20.06.2036 *	267	0,07	Frankreich – 1,10 % (29. Februar 2024: 1,09 %)		
250 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class C, 144A, 7,500 %, fällig 15.11.2027 *	8	–	200 Altice France SA, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	179	0,04
850 Towd Point Mortgage Trust 2015-5, Series 2015 5, Class B3, 144A, 4,012 %, fällig 25.05.2055 *	801	0,20	1.090 Altice France SA, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029	847	0,21
238 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	239	0,06	510 Altice France SA, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	399	0,10
623 Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class A3, 144A, 6,968 %, fällig 25.12.2068	632	0,16	600 Banijay Entertainment SAS, 144A, 8,125 %, fällig 01.05.2029	626	0,15
870 Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class M1, 144A, 7,454 %, fällig 25.12.2068 *	893	0,22	550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	572	0,14
718 Verus Securitization Trust 2023-INV3, Series 2023 INV3, Class A3, 144A, 7,732 %, fällig 25.11.2068 *	735	0,18	1.830 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	1.871	0,46
834 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class A3, 144A, 6,674 %, fällig 25.06.2069	844	0,21		4.494	1,10
225 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	228	0,06	Deutschland – 0,79 % (29. Februar 2024: 0,53 %)		
82 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 5,394 %, fällig 25.12.2045 *	64	0,02	400 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	420	0,10
2.147 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Class B1, 5,229 %, fällig 25.01.2045 *	1.908	0,47	650 TK Elevator US Newco Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.07.2027	644	0,16
283 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Class 2A, 6,186 %, fällig 25.10.2046 *	263	0,06	420 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig 29.04.2025	420	0,10
651 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,062 %, fällig 15.05.2048 *	546	0,13	740 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	741	0,18
686 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Series 2017 C38, Klasse A4, 3,190 %, fällig 15.07.2050	667	0,16	150 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	148	0,04
			890 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	861	0,21
				3.234	0,79
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 71.052 \$)			Guatemala – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,17 %)		
	71.481	17,56	315 Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, fällig 25.03.2029	313	0,08
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 51,96 % (29. Februar 2024: 58,98 %)			363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27.04.2031	324	0,08
Argentinien – 0,42 % (29. Februar 2024: 0,17 %)				637	0,16
580 Pampa Energia SA, 144A, 7,950 %, fällig 10.09.2031	603	0,15	Hongkong – 0,34 % (29. Februar 2024: 0,24 %)		
640 Pan American Energy LLC/Argentina, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2032	694	0,17	230 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 06.06.2025	230	0,06
420 YPF SA, 144A, 6,950 %, fällig 21.07.2027	422	0,10	730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	679	0,17
	1.719	0,42	460 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 7,625 %, fällig 17.04.2032	462	0,11
Brasilien – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,70 %)				1.371	0,34
460 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	413	0,10	Irland – 0,28 % (29. Februar 2024: 0,25 %)		
370 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	325	0,08	350 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	311	0,08
490 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	443	0,11	410 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6,950 %, fällig 10.03.2055 *	423	0,10
610 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	521	0,13	420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.04.2026	417	0,10
390 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	434	0,10		1.151	0,28
	2.136	0,52	Israel – 0,68 % (29. Februar 2024: 0,70 %)		
Kanada – 1,99 % (29. Februar 2024: 2,96 %)			520 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	503	0,12
1.080 Air Canada, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2026	1.058	0,26	990 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	978	0,24
900 Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig 27.01.2084 *	940	0,23	200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	197	0,05
460 Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	471	0,12	1.500 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	1.109	0,27
530 Bombardier Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.06.2032	538	0,13		2.787	0,68
250 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028	245	0,06	Italien – 0,49 % (29. Februar 2024: 0,80 %)		
370 Empire Communities Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.05.2029	386	0,10	475 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	477	0,12
280 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	277	0,07	1.280 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,800 %, fällig 28.11.2053	1.508	0,37
460 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	460	0,11		1.985	0,49
500 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	474	0,12	Kasachstan – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,24 %)		
270 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	250	0,06	230 QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027	222	0,05
250 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	232	0,06	Kuwait – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,14 %)		
600 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082 *	626	0,15	530 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18.05.2030	546	0,13
480 TransAlta Corp, 7,750 %, fällig 15.11.2029	502	0,12	Luxemburg – 0,68 % (29. Februar 2024: 0,73 %)		
880 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	854	0,21	1.960 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	1.540	0,38
800 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	778	0,19	1.140 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	357	0,09
	8.091	1,99	GBP 740 Cidron Aida Finco Srl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	885	0,21
Chile – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				2.782	0,68
520 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	524	0,13	Macau – 0,34 % (29. Februar 2024: 0,82 %)		
			270 Sands China Ltd, 5,125 %, fällig 08.08.2025	270	0,07
			270 Sands China Ltd, 2,300 %, fällig 03.08.2027	255	0,06
			480 Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	482	0,12

[^] 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 28. Februar 2025 – (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, 2,850 %, fällig 03.08.2029	181	0,05	1.500 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	593	0,15
200 Sands China Ltd, 3,250 %, fällig 08.08.2031	175	0,04	400 Alpha Generation LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2032	406	0,10
	1.363	0,34	340 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	342	0,08
Malaysia – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,14 %)					
217 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	149	0,04	340 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2029	288	0,07
Mexiko – 0,32 % (29. Februar 2024: 0,27 %)					
1.020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *	1.012	0,25	220 AMC Networks Inc, 144A, 10,250 %, fällig 15.01.2029	233	0,06
370 Grupo Televisa SAB, 5,000 %, fällig 13.05.2045	279	0,07	270 AMC Networks Inc, 4,250 %, fällig 15.02.2029	210	0,05
	1.291	0,32	610 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	624	0,15
Marokko – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
930 OCP SA, 144A, 6,750 %, fällig 02.05.2034	961	0,24	1.110 American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	1.170	0,29
Niederlande – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,55 %)					
GBP 130 Boost Newco Borrower LLC/GTCR W Dutch Finance Sub BV, 8,500 %, fällig 15.01.2031	175	0,04	1.300 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	1.294	0,32
EUR 400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	414	0,10	190 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030	188	0,05
EUR 1.400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Ewige Anleihe *	1.463	0,36	610 APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	614	0,15
	2.052	0,50	610 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	607	0,15
Peru – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,04 %)					
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19.06.2047	132	0,03	400 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	205	0,05
Singapur – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,06 %)					
640 Puma International Financing SA, 144A, 7,750 %, fällig 25.04.2029	657	0,16	650 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	333	0,08
Südafrika – 0,07 % (29. Februar 2024: 0,07 %)					
310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18.03.2031	265	0,07	350 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	307	0,08
Supranational – 0,77 % (29. Februar 2024: 0,38 %)					
INR 269.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	3.139	0,77	340 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	296	0,07
Schweden – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,12 %)					
470 Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2031	478	0,12	120 Bath & Body Works Inc, 5,250 %, fällig 01.02.2028	120	0,03
Schweiz – 0,85 % (29. Februar 2024: 1,00 %)					
860 UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	910	0,22	800 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030	818	0,20
890 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	976	0,24	160 Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31.01.2027	155	0,04
710 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe *	712	0,18	460 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	444	0,11
590 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	592	0,15	240 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2027	229	0,06
260 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2027	257	0,06	100 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	72	0,02
	3.447	0,85	530 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.07.2032	554	0,14
Türkei – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,19 %)					
900 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 7,375 %, fällig 20.05.2029	922	0,23	730 Boost Newco Borrower LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	764	0,19
Vereinigte Arabische Emirate – 0,22 % (29. Februar 2024: 0,26 %)					
260 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	247	0,06	1.030 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2032	933	0,23
740 Shelf Drilling Holdings Ltd, 144A, 9,625 %, fällig 15.04.2029	655	0,16	480 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2028	478	0,12
	902	0,22	610 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	657	0,16
Vereinigtes Königreich – 1,95 % (29. Februar 2024: 2,79 %)					
380 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	349	0,08	740 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	763	0,19
GBP 810 Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	1.003	0,25	580 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2032	589	0,14
440 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 15.08.2029	462	0,11	970 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	977	0,24
1.300 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, fällig 15.01.2032	1.205	0,30	1.050 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	982	0,24
GBP 270 Lloyds Banking Group Plc, 8,500 %, Ewige Anleihe *	355	0,09	520 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	481	0,12
480 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	504	0,12	2.330 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2031	2.092	0,51
310 Marks & Spencer Plc, 144A, 7,125 %, fällig 01.12.2037	339	0,08	170 CDW LLC / CDW Finance Corp, 3,250 %, fällig 15.02.2029	159	0,04
1.342 McLaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2026	1.346	0,33	390 Charles Schwab Corp/The, 5,853 %, fällig 19.05.2034 *	408	0,10
GBP 1.270 NatWest Group Plc, 4,500 %, Ewige Anleihe *	1.489	0,37	320 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	292	0,07
750 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	718	0,18	210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	192	0,05
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,250 %, fällig 31.01.2031	174	0,04	520 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	423	0,10
	7.944	1,95	1.080 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	1.082	0,27
USA – 37,23 % (29. Februar 2024: 41,27 %)					
330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028	305	0,08	420 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2027	405	0,10
510 Adient Global Holdings Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2033	511	0,13	370 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	258	0,06
286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	284	0,07	490 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	320	0,08
10 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 5,000 %, fällig 30.09.2027	10	–	630 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	535	0,13
660 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030	669	0,16	610 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2031	496	0,12
1.130 Akumin Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.08.2027	972	0,24	630 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	645	0,16
			760 Citigroup Inc, Series W, 4,000 %, Ewige Anleihe *	748	0,18
			180 Citrix Systems Inc, 4,500 %, fällig 01.12.2027	168	0,04
			449 Claritec Corp, 144A, 6,750 %, fällig 31.03.2031	274	0,07
			620 Clean Harbors Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029	604	0,15
			1.430 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.08.2027	1.399	0,34
			730 Cloud Software Group Inc, 144A, 8,250 %, fällig 30.06.2032	758	0,19
			390 CommScope LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.12.2031	406	0,10
			430 CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	406	0,10
			720 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	731	0,18
			1.590 CoreCivic Inc, 4,750 %, fällig 15.10.2027	1.556	0,38
			230 CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2029	244	0,06

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)					
400 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.02.2028	420	0,10	490 LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.03.2029	470	0,12
310 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2032	310	0,08	290 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	281	0,07
1.370 CSC Holdings LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2027	1.272	0,31	6.239 Mcclatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031	6.388	1,57
200 CSC Holdings LLC, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2028	149	0,04	140 Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, fällig 01.04.2029	131	0,03
1.140 CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	1.114	0,27	1.570 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	1.523	0,37
1.200 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	883	0,22	380 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	386	0,09
690 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	743	0,18	320 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	240	0,06
620 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	622	0,15	460 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2028	454	0,11
280 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	276	0,07	370 Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.07.2028	358	0,09
380 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	373	0,09	52 MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 31.12.2030	38	0,01
60 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	54	0,01	80 MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 11,500 %, fällig 31.12.2030	72	0,02
570 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	537	0,13	1.400 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	1.261	0,31
730 DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig 15.11.2027	771	0,19	610 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	626	0,15
1.030 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	921	0,23	330 NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 15.01.2029	350	0,09
1.421 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	1.524	0,37	1.650 NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	1.688	0,41
531 EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	662	0,16	612 New Generation Gas Gathering LLC, 144A, 10,052 %, fällig 30.09.2029 *†∞	603	0,15
734 EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	688	0,17	1.340 Nexstar Media Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2027	1.326	0,33
700 Edison International, Series A, 5,375 %, Ewige Anleihe *	674	0,17	340 Noble Finance II LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2030	344	0,08
470 Endo Finance Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.04.2031	504	0,12	1.020 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	1.036	0,25
220 Energy Transfer LP, 5,350 %, fällig 15.05.2045	204	0,05	2.790 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 [∞] g	–	–
260 Entegris Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2028	251	0,06	680 NRG Energy Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.11.2034	683	0,17
420 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2028 *	413	0,10	1.050 Occidental Petroleum Corp, 7,150 %, fällig 15.05.2028	1.114	0,27
190 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2027	195	0,05	640 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	669	0,16
278 EQM Midstream Partners LP, 144A, 4,500 %, fällig 15.01.2029	271	0,07	1.660 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	1.921	0,47
850 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2030	925	0,23	310 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	224	0,06
80 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	86	0,02	140 Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	144	0,04
560 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	594	0,15	700 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	698	0,17
30 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2033	31	0,01	14 Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, fällig 15.07.2031	15	–
440 Esab Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2029	448	0,11	670 Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2032	689	0,17
1.060 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	1.006	0,25	300 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	302	0,07
1.060 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	1.041	0,26	1.130 PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	1.094	0,27
250 FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	245	0,06	680 Plains All American Pipeline LP, Series B, 8,695 %, Ewige Anleihe *	682	0,17
220 FirstEnergy Corp, 2,650 %, fällig 01.03.2030	198	0,05	2.555 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	2.491	0,61
915 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 10,500 %, fällig 15.01.2028	937	0,23	370 PNC Financial Services Group Inc/The, 6,037 %, fällig 28.10.2033 *	391	0,10
970 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	834	0,20	400 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,068 %, fällig 24.01.2034 *	398	0,10
1.190 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	994	0,24	880 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	837	0,21
1.250 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	1.093	0,27	190 Primo Water Holdings Inc / Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	189	0,05
2.130 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	2.032	0,50	920 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	934	0,23
1.660 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	1.673	0,41	125 Rackspace Finance LLC, 144A, 3,500 %, fällig 15.05.2028	69	0,02
40 Gannett Co Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.12.2027	43	0,01	100 Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	102	0,03
1.540 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	1.589	0,39	1.140 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	1.175	0,29
570 Gen Digital Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2033	572	0,14	770 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	736	0,18
620 GEO Group Inc/The, 10,250 %, fällig 15.04.2031	680	0,17	1.670 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.03.2029	1.553	0,38
240 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	240	0,06	230 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	199	0,05
1.640 GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	1.578	0,39	220 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2038	222	0,05
860 GFL Environmental Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2031	893	0,22	410 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2040	405	0,10
450 Gray Media Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.05.2027	442	0,11	570 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	563	0,14
970 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	971	0,24	230 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31.08.2026	232	0,06
370 HCA Inc, 7,500 %, fällig 06.11.2033	415	0,10	140 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 30.09.2031	139	0,03
650 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2032	622	0,15	260 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	265	0,07
340 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig 01.11.2033	356	0,09	710 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	718	0,18
400 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 8,875 %, fällig 15.07.2028	422	0,10	790 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	811	0,20
380 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.07.2032	396	0,10	600 RXO Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.11.2027	616	0,15
143 iHeartCommunications Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.05.2029	121	0,03	650 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	601	0,15
220 Intel Corp, 5,700 %, fällig 10.02.2053	207	0,05			
320 Intercontinental Exchange Inc, 3,625 %, fällig 01.09.2028	311	0,08			
1.380 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2029	1.307	0,32			
1.240 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	1.287	0,32			
540 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	542	0,13			
270 Jazz Securities DAC, 144A, 4,375 %, fällig 15.01.2029	259	0,06			
530 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	555	0,14			
480 Ladder Capital Finance Holdings LLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2031	499	0,12			
900 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	962	0,24			
1.270 Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	1.321	0,32			

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)			Sambia – 0,76 % (29. Februar 2024: 0,61 %)		
USA – (Fortsetzung)			430 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027		
260 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2032	264	0,06	1.060 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig 01.03.2029	1.132	0,28
200 Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2028	202	0,05	700 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	730	0,18
390 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	380	0,09	800 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	816	0,20
600 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	612	0,15		3.112	0,76
660 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029	616	0,15	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 212.832 \$)		
420 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 8,875 %, fällig 15.11.2031	451	0,11		211.490	51,96
580 Snap Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2033	588	0,14	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 4,02 % (29. Februar 2024: 4,55 %)		
980 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	1.009	0,25	Angola – 0,15 % (29. Februar 2024: 0,16 %)		
1.550 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 te	1.349	0,33	460 Internationale Staatsanleihe Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	412	0,10
508 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 te	442	0,11	230 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 9,125 %, fällig 26.11.2049	186	0,05
500 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	602	0,15		598	0,15
390 Starwood Property Trust Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2029	406	0,10	Argentinien – 0,78 % (29. Februar 2024: 0,59 %)		
390 State Street Corp, Series I, 6,700 %, Ewige Anleihe *	400	0,10	7 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	5	–
350 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	264	0,07	42 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	31	0,01
260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	252	0,06	371 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,625 %, fällig 01.09.2037	246	0,06
610 Tenet Healthcare Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2028	590	0,15	2.797 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	1.857	0,45
310 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	314	0,08	1.074 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	1.045	0,26
930 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	923	0,23		3.184	0,78
510 TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.05.2028	513	0,13	Bahamas – 0,15 % (29. Februar 2024: 0,06 %)		
330 TKC Holdings Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2029	339	0,08	400 Bahamas, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,000 %, fällig 21.11.2028	385	0,09
1.030 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	956	0,23	220 Bahamas, Internationale Staatsanleihe, 8,950 %, fällig 15.10.2032	229	0,06
210 TopBuild Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2032	190	0,05		614	0,15
1.580 TransDigm Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.03.2032	1.612	0,40	Brasilien – 0,41 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
300 Truist Financial Corp, 5,122 %, fällig 26.01.2034 *	297	0,07	BRL 1.784 Brasilien, Letras do Tesouro Nacional, Series LTN, Nullkupon, fällig 01.01.2026	270	0,06
410 Truist Financial Corp, 5,867 %, fällig 08.06.2034 *	426	0,10	BRL 10.261 Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.413	0,35
1.080 Tutor Perini Corp, 144A, 11,875 %, fällig 30.04.2029	1.193	0,29		1.683	0,41
96 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	96	0,02	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,34 % (29. Februar 2024: 0,36 %)		
420 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	415	0,10	1.400 Côte d'Ivoire, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,625 %, fällig 30.01.2033	1.375	0,34
2.090 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.12.2029	2.125	0,52	Dominikanische Republik – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,26 %)		
384 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	410	0,10	160 Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 4,500 %, fällig 30.01.2030	150	0,04
82 US Airways 2013-1 Class A Pass Through Trust, 3,950 %, fällig 15.11.2025	82	0,02	940 Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 4,875 %, fällig 23.09.2032	861	0,21
396 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	343	0,08		1.011	0,25
540 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2029	504	0,12	Ägypten – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,06 %)		
1.090 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	1.116	0,27	260 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 7,053 %, fällig 15.01.2032	226	0,05
200 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	182	0,04	El Salvador – 0,17 % (29. Februar 2024: 0,02 %)		
290 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	252	0,06	210 Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 9,250 %, fällig 17.04.2030	224	0,05
620 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.02.2029	685	0,17	440 Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 9,650 %, fällig 21.11.2054	468	0,12
260 Venture Global LNG Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.06.2031	271	0,07		692	0,17
740 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig 01.02.2032	810	0,20	Äthiopien – 0,06 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
1.300 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	1.323	0,33	270 Föderale Republik Äthiopien, 0,000 %, fällig 11.12.2025	232	0,06
218 Vericast Corp/Harland Clarke/Checks in the Mail/Valassis Comm/Valassis Direct, 144A, 13,000 %, fällig 15.12.2030	259	0,06	Ghana – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,04 %)		
610 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	587	0,14	5 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, Nullkupon, fällig 03.07.2026	5	–
660 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	683	0,17	53 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, 5,000 %, fällig 03.07.2029	47	0,01
380 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	367	0,09	77 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, 5,000 %, fällig 03.07.2035	57	0,02
430 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.10.2029	395	0,10		109	0,03
710 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	718	0,18	Jamaika – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,05 %)		
870 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	945	0,23	JMD 30.000 Internationale Staatsanleihe Jamaika, 6,625 %, fällig 11.12.2024	198	0,05
1.010 Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2032	1.043	0,26	Jordanien – 0,19 % (29. Februar 2024: 0,20 %)		
1.230 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	1.208	0,30	560 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	572	0,14
508 Vortex Opco LLC, 144A, 8,000 %, fällig 30.04.2030	178	0,04	200 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 7,500 %, fällig 13.01.2029	202	0,05
1.270 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	1.159	0,28		774	0,19
1.000 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	882	0,22			
220 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	264	0,06			
537 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	537	0,13			
550 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	130	0,03			
710 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	748	0,18			
620 XPO Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.06.2028	628	0,15			
960 Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2030	887	0,22			
	151.514	37,23			

[^] 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 28. Februar 2025 – (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 – 0,32 % (29. Februar 2024: 0,35 %)							
1.150	Internationale Anleihe der Republik Kenia, 144A, 9,750 %, fällig 16.02.2031	1.164	0,28	652	Assuredpartners Inc, 7,812 %, fällig 14.02.2031 *	653	0,16
200	Internationale Anleihe der Republik Kenia, 6,300 %, fällig 23.01.2034	163	0,04	561	Asurion LLC, 8,662 %, fällig 19.08.2028 *	562	0,14
		1.327	0,32	191	Asurion LLC, 8,412 %, fällig 17.08.2028 *	191	0,05
Mexiko – 0,58 % (29. Februar 2024: 1,45 %)							
MXN 13.270	Mexikanische Bonos, Serie M, 5,750 %, fällig 05.03.2026	626	0,16	190	Asurion LLC, 8,562 %, fällig 13.09.2030 *	189	0,05
MXN 9.520	Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	413	0,10	313	Autokiniton U.S. Holdings, 8,426 %, fällig 06.04.2028 *	311	0,08
710	Internationale Staatsanleihe Mexiko, 6,000 %, fällig 07.05.2036	691	0,17	245	Brown Group Holding LLC, 6,812 %, fällig 01.07.2031 *	245	0,06
790	Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 4,750 %, fällig 08.03.2044	624	0,15	89	Brown Group Holding LLC, 7,014 %, fällig 02.07.2029 *	89	0,02
		2.354	0,58	181	Caesars Entertainment Inc, 6,562 %, fällig 06.02.2030 *	181	0,05
Mosambik – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,00 %)							
220	Internationale Anleihe Mosamik, 9,000 %, fällig 15.09.2031	179	0,04	705	Caesars Entertainment Inc, 6,562 %, fällig 06.02.2031 *	707	0,17
Nigeria – 0,13 % (29. Februar 2024: 0,13 %)							
340	Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 7,143 %, fällig 23.02.2030	319	0,08	256	Cardinal Parent Inc, 8,979 %, fällig 12.11.2027 *	246	0,06
260	Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,625 %, fällig 28.11.2047	208	0,05	308	Chromalloy Corp, 8,079 %, fällig 24.03.2031 *	309	0,08
		527	0,13	865	Cinemark, 7,079 %, fällig 24.05.2030 *	872	0,21
Rumänien – 0,11 % (29. Februar 2024: 0,00 %)							
430	Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,500 %, fällig 10.02.2037	443	0,11	628	Clarios Global LP, 6,812 %, fällig 06.05.2030 *	627	0,15
Senegal – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,04 %)							
200	Internationale Staatsanleihe Senegal, 6,250 %, fällig 23.05.2033	157	0,04	473	Cloudera Inc, 8,162 %, fällig 10.10.2028 *	472	0,12
Sri Lanka – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,03 %)							
26	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 4,000 %, fällig 15.04.2028	24	0,01	135	DCert Buyer, Inc., 8,312 %, fällig 16.10.2026 *	131	0,03
22	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,100 %, fällig 15.01.2030	20	–	1.500	DCert Buyer, Inc., 11,312 %, fällig 16.02.2029 *	1.227	0,30
43	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,350 %, fällig 15.03.2033	35	0,01	786	DS Parent Inc, 9,829 %, fällig 16.12.2030 *	742	0,18
29	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.06.2035	20	0,01	120	EMRLD Borrower LP, 6,829 %, fällig 18.06.2031 *	120	0,03
20	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.05.2036	16	–	252	Evertec Group LLC, 7,062 %, fällig 15.10.2030 *	254	0,06
40	Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.02.2038	33	0,01	74	Eyecare Tranche, 5,393 %, fällig 15.11.2028 *	59	0,01
		148	0,04	393	First Brands Group LLC, 9,552 %, fällig 30.03.2027 *	378	0,09
Ukraine – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,06 %)							
22	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2030	12	–	524	First Brands Group LLC, 9,552 %, fällig 24.03.2027 *	504	0,12
80	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2034	35	0,01	19	Focus Financial Partners LLC, 0,000 %, fällig 15.09.2031 *	19	0,01
79	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 01.02.2034	47	0,01	61	Focus Financial Partners LLC, 7,054 %, fällig 15.09.2031 *	61	0,02
68	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2035	45	0,01	403	Gainwell Acquisition Corp, 8,429 %, fällig 01.10.2027 *	376	0,09
138	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 01.02.2035	81	0,02	480	Gannett Holdings LLC, 9,308 %, fällig 15.10.2029 *	479	0,12
57	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2036	37	0,01	292	Geo Group Inc/The, 9,560 %, fällig 04.04.2029 *	298	0,07
177	Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 01.02.2036	103	0,03	269	Gray Television, 9,559 %, fällig 23.05.2029 *	255	0,06
		360	0,09	612	Graystone Select Financial, 9,555 %, fällig 06.05.2028 *	612	0,15
Usbekistan – 0,04 % (29. Februar 2024: 0,05 %)							
220	Internationale Anleihe der Republik Usbekistan, 3,900 %, fällig 19.10.2031	186	0,04	108	Howden Group Holdings Ltd, 7,812 %, fällig 18.04.2030 *	108	0,03
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 16.286 \$)							
		16.377	4,02	181	Jazz Financing Lux S.a.r.l., 6,562 %, fällig 05.05.2028 *	181	0,04
Schuldscheindarlehen – 6,68 % (29. Februar 2024: 7,01 %)							
90	1011778 Bc ULC, 6,062 %, fällig 23.09.2030 *	89	0,02	277	Learfield Communications LLC, 9,062 %, fällig 30.06.2028 *	280	0,07
430	8Th Avenue Food & Provisions Inc, 12,176 %, fällig 01.10.2026 *	398	0,10	383	LifePoint Health Inc, 8,052 %, fällig 14.05.2031 *	370	0,09
310	A-AP Buyer Inc, 7,562 %, fällig 01.08.2031 *	311	0,08	229	LifePoint Health Inc, 7,965 %, fällig 19.05.2031 *	222	0,06
840	ABG Intermediate Holdings, 0,000 %, fällig 12.02.2032 *	836	0,21	198	LTR Intermediate Holdings Inc, 8,926 %, fällig 08.05.2028 *	194	0,05
454	Acrisure, 7,312 %, fällig 06.11.2030 *	455	0,11	686	Medline Borrower LP, 6,562 %, fällig 21.10.2028 *	688	0,17
435	Agiliti Health Inc, 7,310 %, fällig 01.05.2030 *	424	0,10	473	MH Sub I LLC, 8,562 %, fällig 03.05.2028 *	463	0,11
86	Allen Media LLC, 9,979 %, fällig 10.02.2027 *	52	0,01	320	MH Sub I LLC, 8,562 %, fällig 31.12.2031 *	308	0,08
900	Alliance Laundry Systems LLC, 7,072 %, fällig 19.08.2031 *	902	0,22	684	MRI Software LLC, 9,079 %, fällig 10.02.2027 *	678	0,17
350	Allied Universal Holdco LLC, 8,162 %, fällig 14.05.2028 *	351	0,09	190	MRI Software LLC, 9,079 %, fällig 10.02.2027 *	188	0,05
577	Allwyn Entertainment Financing, 6,307 %, fällig 11.06.2031 *	576	0,14	511	Neptune Bidco U.S. Inc, 9,139 %, fällig 11.10.2028 *	454	0,11
280	Amwins, 6,560 %, fällig 23.01.2032 *	280	0,07	944	Nexus Buyer LLC, 7,809 %, fällig 31.07.2031 *	945	0,23
32	API Group De Inc., 6,064 %, fällig 03.01.2029 *	32	0,01	250	NGP XI Midstream, 0,000 %, fällig 25.07.2031 *	252	0,06
66	Apollo Group CMR, 7,176 %, fällig 15.05.2026 *	66	0,02	440	Peer Holding III BV, 7,329 %, fällig 23.06.2031 *	442	0,11
238	Ascensus Holdings Inc, 7,312 %, fällig 02.08.2028 *	237	0,06	502	Planview, 7,829 %, fällig 17.12.2027 *	503	0,12
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 27.424 \$)							
				723	Polyconcept North America Holdings Inc, 9,829 %, fällig 12.05.2029 *	707	0,17
Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,04 %)							
Schweiz – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,04 %)							
1.310 Credit Suisse Group AG Escrow †∞ – –							
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$) – –							
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 377.718 \$)							
				244	Quikrete Holdings, Inc., 6,562 %, fällig 26.03.2029 *	244	0,06
				364	Sedgwick Claims Managment, 7,312 %, fällig 30.06.2031 *	365	0,09
				744	Spirit Airlines, 11,322 %, fällig 18.11.2025 *†	745	0,18
				109	Televisaunivision, 7,926 %, fällig 31.01.2029 *	109	0,03
				290	Two Kings Casino, 0,000 %, fällig 16.12.2031 *	293	0,07
				430	Varsity Brand, 8,068 %, fällig 28.07.2031 *	430	0,11
				308	Vericast Corp, 12,035 %, fällig 15.06.2030 *	295	0,07
				244	Vertex Aerospace Services LLC, 6,562 %, fällig 06.12.2030 *	243	0,06
				260	Virgin Media Bristol LLC, 6,926 %, fällig 04.01.2028 *	255	0,06
				210	WH Borrower LLC, 9,072 %, fällig 12.02.2032 *	211	0,05
				200	WW International Inc, 8,052 %, fällig 13.04.2028 *	51	0,01
				770	X Corp, 0,000 %, fällig 26.10.2029 *	769	0,19
				Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 249 \$)			
						304	0,07

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	
Credit Default Swaps – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	118	0,03	
Index-Swaps – 0,02 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	89	0,02	
Devisenterminkontrakte – 1,22 % (29. Februar 2024: 0,40 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4.968	1,22	
Futures – 0,18 % (29. Februar 2024: 0,17 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	729	0,18	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
	382.775	94,04	
Zinsswaps – –0,19 % (29. Februar 2024: –0,07 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-774	-0,19	
Devisenterminkontrakte – –0,15 % (29. Februar 2024: –0,11 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-630	-0,15	
Futures – –0,11 % (29. Februar 2024: –0,07 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-428	-0,11	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
	-1.832	-0,45	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
	380.943	93,59	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
	26.080	6,41	
Gesamtnettvermögen			
	407.023 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 250.270.000 \$ und machten 61,52 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

† Nicht liquide.

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

ε Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2025 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 28. Februar 2025.

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

INR – Indische Rupie

JMD – Jamaikanischer Dollar

MXN – Mexikanischer Peso

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,52
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	6,57
Derivative Finanzinstrumente	1,50
Sonstige Vermögenswerte	7,41
Gesamtvermögen	100,00

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.NA.IG, 1.000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	5.468	\$ 118
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 232 \$)				\$ 118
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 232 \$)				\$ 118

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominal- betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 12,320 %	3. Jan. 2033	22.990	\$ -300
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	02. Jan. 2029	23.600	-474
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -286 \$)				-774
Nettowertminderung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -286 \$)				\$ -774

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeits- datum	Nominal- betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIIE ON-OIS Compound, erhält festen Zinssatz von 8,885 %	10. Nov. 2034	87.190	\$ 89
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ 89
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ 89

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2025	Citi	Kauf	USD	2.187	Verkauf	BRL 12.710	\$ 30
6. März 2025	Citi	Kauf	BRL	9.081	Verkauf	USD 1.531	10
6. März 2025	Citi	Kauf	BRL	8.429	Verkauf	USD 1.463	-34
6. März 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD	540	Verkauf	BRL 3.130	10
6. März 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD	281	Verkauf	BRL 1.670	-2

^ 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 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 1.177	Verkauf	GBP 934	\$ 3	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 194	Verkauf	GBP 155	-2	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 224.144	Verkauf	USD 277.676	4.266	
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF 43	Verkauf	USD 48	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF 3.687	Verkauf	USD 4.064	25	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 52.237	Verkauf	USD 53.963	260	
14. März 2025	BNY	Kauf	CAD 24.540	Verkauf	USD 17.157	-186	
14. März 2025	BNY	Kauf	JPY 40.489	Verkauf	USD 272	-2	
14. März 2025	BNY	Kauf	JPY 3.712.976	Verkauf	USD 24.572	128	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 379	Verkauf	USD 399	-5	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 2.921	Verkauf	USD 3.694	-19	
02. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.171	Verkauf	BRL 6.769	30	
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 523	Verkauf	EUR 500	3	
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	EUR 770	Verkauf	USD 805	-4	
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	AUD 3.608	Verkauf	USD 2.234	6	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 41	Verkauf	CAD 59	–	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 7.269	Verkauf	GBP 5.896	-147	
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	EUR 400	Verkauf	USD 418	-2	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 997	Verkauf	INR 86.950	6	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.091	Verkauf	JPY 161.640	12	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.885	Verkauf	JPY 286.910	-32	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 3.062	Verkauf	MXN 63.780	-22	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	JPY 597.932	Verkauf	USD 3.839	154	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	NOK –	Verkauf	USD –	–	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	MXN 58.800	Verkauf	USD 2.863	-21	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	GBP 554	Verkauf	USD 689	8	
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	CHF 2	Verkauf	USD 2	–	
16. Apr. 2025	Goldman Sachs	Kauf	EUR 380	Verkauf	USD 397	-2	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 8.199	Verkauf	CNH 60.177	-73	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 2.191	Verkauf	INR 192.770	-5	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	CNH 15.770	Verkauf	USD 2.180	-12	
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	CNH 7.880	Verkauf	USD 1.082	2	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 6.381	Verkauf	EUR 6.168	-33	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 4.595	Verkauf	MXN 94.770	15	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	EUR 950	Verkauf	USD 999	-10	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	MXN 9.835	Verkauf	USD 475	–	
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	MXN 57.696	Verkauf	USD 2.800	-12	
06. Mai 2025	BNP Paribas	Kauf	CNH 5.215	Verkauf	USD 723	-5	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1.501 \$)						\$	4.968
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -403 \$)							-630
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1.098 \$)						\$	4.338

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Australia 10 Year Bond März 2025	Bank of America Merrill Lynch	20	\$ 1.409	\$ -14
Euro-Bund März 2025	Bank of America Merrill Lynch	85	11.744	-322
ICE 3-Monats-SONIA Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	1	300	2
Long Gilt Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	67	7.874	73
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-53	-5.888	-62
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-4	-457	-11
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	221	45.740	229
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-43	-4.641	-19
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	37	4.369	90
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	101	12.537	335
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 620 \$)				\$ 729
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -253 \$)				-428
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 367 \$)				\$ 301

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 17,12 % (29. Februar 2024: 15,66 %)								
640	1988 CLO 5 Ltd, Series 2024 5A, Class D1, 144A, 7,602 %, fällig 15.07.2037 *	654	0,13	1.700	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	578	0,11	
1.190	Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M5, 5,895 %, fällig 25.04.2035 *	1.221	0,24	1.234	Mosaic Solar Loan Trust 2024-1, Series 2024 1A, Class B, 144A, 6,250 %, fällig 20.09.2049	1.177	0,23	
320	AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 7,203 %, fällig 17.07.2037 *	324	0,06	3.000	National Collegiate II Commutation Trust, Serie 2005 AR15, Klasse AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	165	0,03	
500	Apidos Clo Xlix, Series 2024 49A, Class E, 144A, 10,146 %, fällig 24.10.2037 *	506	0,10	7.577	National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 4,934 %, fällig 27.07.2037 *	6.097	1,18	
600	Ballyrock CLO 14 Ltd, Series 2020 14A, Class C1R, 144A, 7,293 %, fällig 20.07.2037 *	612	0,12	5.975	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A5, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	1.009	0,20	
500	Ballyrock CLO 14 Ltd, Series 2020 14A, Class DR, 144A, 10,143 %, fällig 20.07.2037 *	508	0,10	6.128	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	999	0,19	
553	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A2, 7,331 %, fällig 28.08.2047	481	0,09	790	Neuberger Berman Loan Advisers Clo 56 Ltd, Series 2024 56A, Class E, 144A, 10,047 %, fällig 24.07.2037 *	804	0,15	
1.244	Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Serie 2007 B, Klasse 1A3, 7,719 %, fällig 28.08.2047	331	0,06	1.683	NRM FNT1 Excess LLC, Series 2024 FNT1, Class A, 144A, 7,398 %, fällig 25.11.2031	1.712	0,33	
42	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 2,813 %, fällig 25.09.2034 *	41	0,01	835	Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class ER, 144A, 11,793 %, fällig 20.07.2035 *	844	0,16	
1.759	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse B, 144A, 5,682 %, fällig 16.12.2041	1.766	0,34	1.350	Ocp Clo 2024-33 Ltd, Series 2024 33A, Class E, 144A, 10,293 %, fällig 20.07.2037 *	1.377	0,27	
800	CarVal CLO VII-C Ltd, Series 2023 1A, Class D1R, 144A, 7,443 %, fällig 20.07.2037 *	815	0,16	2.000	OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D2, 144A, 8,543 %, fällig 20.07.2037 *	2.033	0,39	
1.250	Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,693 %, fällig 20.07.2037 *	1.274	0,25	2.567	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 6,217 %, fällig 25.04.2035	2.117	0,41	
1.410	CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class E, 144A, 10,921 %, fällig 20.10.2037 *	1.440	0,28	2.118	Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-5, Series 2005 5, Class MV2, 3,635 %, fällig 25.11.2035 *	1.892	0,37	
1.261	Conseco Finance Corp, Series 1999 4, Class A8, 7,700 %, fällig 01.05.2031 *	413	0,08	404	SEB Funding LLC, Series 2021 1A, Class A2, 144A, 4,969 %, fällig 30.01.2052	397	0,08	
2.804	Conseco Finance Corp, Series 1999 4, Class A9, 7,020 %, fällig 01.05.2031 *	852	0,17	2.370	SEB Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2, 144A, 7,386 %, fällig 30.04.2054	2.464	0,48	
5.526	Conseco Finance Securitizations Corp, Series 2000 3, Class A, 144A, 8,260 %, fällig 01.12.2030 *	1.052	0,20	1.782	Sesac Finance LLC, Series 2024 1, Class A2, 144A, 6,421 %, fällig 25.01.2054	1.805	0,35	
741	Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1, Class A1, 144A, 5,334 %, fällig 25.03.2047 *	576	0,11	3.328	SMB Private Education Loan Trust 2022-A, Series 2022 A, Class D, 144A, 4,750 %, fällig 16.11.2054	3.158	0,61	
369	Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1, Class A4, 144A, 6,731 %, fällig 25.12.2036	368	0,07	2.500	SMB Private Education Loan Trust 2024-D, Series 2024 D, Class D, 144A, 7,510 %, fällig 15.07.2053	2.554	0,50	
1.888	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Serie 2004 9, Class MF2, 5,572 %, fällig 25.11.2034 *	1.827	0,35	120	SOFI PROFESSIONAL LOAN PROGRAM 2017-F LLC, Serie 2017 F, Klasse R1, 144A, 0,000 %, fällig 25.01.2041	954	0,19	
1.321	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2007-A, Serie 2007 A, Class A, 4,546 %, fällig 15.04.2037 *	1.234	0,24	2.011	Stonepeak 2021-1 ABS, Serie 2021 1A, Klasse B, 144A, 3,821 %, fällig 28.02.2033	1.930	0,38	
1.224	Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Serie 2018 1, Klasse D, 144A, 6,390 %, fällig 20.07.2038	1.070	0,21	3.424	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2, 5,409 %, fällig 25.06.2035 *	3.571	0,69	
2.513	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Serie 2018 2, Klasse D, 144A, 5,910 %, fällig 20.12.2038	2.161	0,42	2.342	Sunnova Sol Issuer LLC, Serie 2020 1A, Klasse B, 144A, 5,540 %, fällig 01.02.2055	1.962	0,38	
1	DRB Prime Student Loan Trust 2017-A, Series 2017 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 27.05.2042	2.115	0,41	990	Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,690 %, fällig 23.07.2037 *	999	0,19	
1.076	FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig 30.10.2053	1.154	0,22	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 107.245 \$)			88.201	17,12
6.256	Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Class 1A, 4,584 %, fällig 25.08.2036 *	2.469	0,48	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 74,99 % (29. Februar 2024: 74,61 %)				
700	Golub Capital Partners CLO 60B Ltd, Series 2022 60A, Class ER, 144A, 10,300 %, fällig 25.10.2034 *	705	0,14	5.919	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class F, 144A, 7,438 %, fällig 15.09.2034 *	5.679	1,10	
580	Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 7,500 %, fällig 25.07.2037 *	592	0,11	893	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Serie 2005 80CB, Klasse 2A1, 6,000 %, fällig 25.02.2036	863	0,17	
400	Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class E, 144A, 10,492 %, fällig 25.10.2037 *	411	0,08	591	Alternative Loan Trust 2006-19CB, Series 2006 19CB, Class A20, 10,597 %, fällig 25.08.2036 *	417	0,08	
2.281	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Serie 2021 4GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.07.2048	1.826	0,35	4.569	Alternative Loan Trust 2006-28CB, Series 2006 28CB, Class A12, 1,466 %, fällig 25.10.2036 *†	475	0,09	
2.868	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Serie 2022 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2049	1.963	0,38	905	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Series 2007 23CB, Class A8, 10,665 %, fällig 25.09.2037 *	712	0,14	
2.116	HERO Funding Trust 2016-1, Serie 2016 1A, Klasse R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	325	0,06	6.086	Alternative Loan Trust 2007-5CB, Series 2007 5CB, Class 1A20, 1,026 %, fällig 25.04.2037 *†	550	0,11	
3.312	Home Partners of America 2021-2 Trust, Serie 2021 2, Klasse F, 144A, 3,799 %, fällig 17.12.2026	3.179	0,62	4.122	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class E, 144A, 4,489 %, fällig 15.02.2050 *	3.405	0,66	
1.770	Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 10,352 %, fällig 25.10.2033 *	1.937	0,38	6.000	BBCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class F, 144A, 4,563 %, fällig 10.08.2033 *	3.583	0,70	
3.109	Horizon Aircraft Finance III Ltd, Series 2019 2, Class A, 144A, 3,425 %, fällig 15.11.2039	2.983	0,58	4.879	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 10A2, 144A, 3,990 %, fällig 26.07.2046 *	4.122	0,80	
1.000	HPS Loan Management 2024-20 Ltd, Series 2024 20A, Class D2, 144A, 8,800 %, fällig 25.07.2037 *	1.021	0,20	697	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Series 2007 AA3, Class 1A2, 4,974 %, fällig 25.04.2037 *	1.056	0,21	
1.878	Labrador Aviation Finance Ltd 2016-1A, Series 2016 1A, Class A1, 144A, 4,300 %, fällig 15.01.2042	1.818	0,35	978	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Serie 2004 AC6, Klasse A1, 5,750 %, fällig 25.11.2034	858	0,17	
1.182	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Serie 2021 1GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2048	910	0,18	2.820	BF 2019-NYT Mortgage Trust, Series 2019 NYT, Class E, 144A, 7,109 %, fällig 15.12.2035 *	2.583	0,50	
2.149	Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2048	1.564	0,30	4.510	BHMS 2018-MZB, Series 2018 MZB, Class MZB, 144A, 11,245 %, fällig 15.07.2025 *	4.481	0,87	
1.033	Loanpal Solar Loan Ltd, Serie 2020 3GS, Klasse C, 144A, 3,500 %, fällig 20.12.2047	801	0,16	3.500	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class M1, 144A, 6,819 %, fällig 25.02.2064	3.551	0,69	
30	Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Series 2002 2, Class M2, 6,225 %, fällig 25.07.2032 *	29	0,01	2.177	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A3, 144A, 6,158 %, fällig 25.06.2064	2.190	0,43	
900	Marble Point CLO XVII Ltd, Series 2020 1A, Class D1R, 144A, 7,943 %, fällig 20.07.2037 *	908	0,18	2.653	Bravo Residential Funding Trust Series 2025-NQM1, Series 2025 NQM1, Class A3, 144A, 5,908 %, fällig 25.12.2064	2.671	0,52	
44	Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2, Class A, 144A, 4,954 %, fällig 25.02.2036 *	43	0,01	3.500	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust, Series 2013 1515, Class F, 144A, 3,927 %, fällig 10.03.2033 *	3.081	0,60	
1.317	MMAF Equipment Finance LLC 2022-B, Series 2022 B, Class A3, 144A, 5,610 %, fällig 10.07.2028	1.321	0,26	4.000	BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Series 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041 *	4.000	0,78	
3	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Series 2003 SD1, Class A1, 5,434 %, fällig 25.03.2033 *	3	–					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
1.750 BX Trust 2018-GW MZ, Series 2018 GWMZ, Class MC, 144A, 10,097 %, fällig 15.05.2037 *	1.748	0,34	1.942 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	1.887	0,37
1.750 BX Trust 2018-GW, Series 2018 GW, Class G, 144A, 7,529 %, fällig 15.05.2035 *	1.750	0,34	11.274 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 2,702 %, fällig 25.11.2057 *	4.261	0,83
870 BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class E, 144A, 8,026 %, fällig 15.06.2036 *	859	0,17	15.874 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class BX, 144A, 0,941 %, fällig 25.08.2057 *	5.582	1,08
209 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-25, Series 2005 25, Class A15, 7,447 %, fällig 25.11.2035 *	122	0,02	4.910 Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA1, Series 2016 DNA1, Class B, 14,466 %, fällig 25.07.2028 *	5.256	1,02
603 Citicorp Mortgage Securities Trust Serie 2007-3, Serie 2007 3, Klasse 1A4, 6,000 %, fällig 25.04.2037	570	0,11	2.719 Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA4, Series 2016 DNA4, Class B, 13,066 %, fällig 25.03.2029 *	2.990	0,58
3.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class D, 144A, 3,110 %, fällig 10.04.2048	2.411	0,47	6.074 Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-HRP1, Series 2017 HRP1, Class B2D, 7,466 %, fällig 25.12.2042 *	5.914	1,15
3.125 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class D, 144A, 3,225 %, fällig 15.09.2048	2.877	0,56	6.470 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B2, 144A, 9,716 %, fällig 25.01.2050 *	7.264	1,41
4.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class E, 144A, 4,374 %, fällig 15.09.2048 *	3.110	0,60	8.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class B2, 144A, 9,266 %, fällig 25.02.2050 *	8.786	1,71
754 Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Serie 2008 3, Klasse A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	347	0,07	1.640 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Series 2021 DNA2, Class B2, 144A, 10,352 %, fällig 25.08.2033 *	1.996	0,39
3.529 Citigroup Mortgage Loan Trust 2014-J2, Series 2014 J2, Class B5, 144A, 3,837 %, fällig 25.11.2044 *	2.351	0,46	530 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 9,852 %, fällig 25.01.2034 *	627	0,12
1.204 COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust, Series 2024 2, Class A3, 144A, 6,429 %, fällig 25.04.2069	1.213	0,24	5.020 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B2, 144A, 11,852 %, fällig 25.10.2041 *	5.418	1,05
1.016 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 7,866 %, fällig 25.10.2039 *	1.051	0,20	3.640 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4, Series 2021 HQA4, Class B2, 144A, 11,352 %, fällig 25.12.2041 *	3.914	0,76
5.760 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 7,452 %, fällig 25.10.2041 *	5.920	1,15	5.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B2, 144A, 12,852 %, fällig 25.02.2042 *	5.526	1,07
5.735 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B2, 144A, 10,352 %, fällig 25.10.2041 *	6.047	1,17	5.500 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2025-DNA1, Series 2025 DNA1, Class M2, 144A, 5,702 %, fällig 25.01.2045 *	5.509	1,07
3.000 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1B2, 144A, 10,352 %, fällig 25.12.2041 *	3.175	0,62	3.995 Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SP11, Series 2018 SP11, Class B, 144A, 3,786 %, fällig 25.02.2048 *	2.901	0,56
2.520 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02, Series 2022 R02, Class 2B2, 144A, 12,002 %, fällig 25.01.2042 *	2.746	0,53	5.000 Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B2, 144A, 12,216 %, fällig 25.09.2048 *	5.862	1,14
1.500 CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,354 %, fällig 15.08.2048 *	1.308	0,25	4.620 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Class B2, 144A, 15,216 %, fällig 25.01.2049 *	5.759	1,12
224 CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 5,604 %, fällig 25.06.2034 *	179	0,03	3.910 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B2, 144A, 12,616 %, fällig 25.07.2049 *	4.498	0,87
4.400 CSMC 2014-USA OA LLC, Serie 2014 USA, Klasse E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	2.518	0,49	5.550 Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B2, 144A, 10,716 %, fällig 25.10.2049 *	6.257	1,21
4.266 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B3, 144A, 2,974 %, fällig 25.07.2057 *	2.324	0,45	2.000 Freddie Mac STACR Trust 2019-FTR4, Series 2019 FTR4, Class B2, 144A, 9,466 %, fällig 25.11.2047 *	2.172	0,42
4.178 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B4, 144A, 2,974 %, fällig 25.07.2057 *	1.338	0,26	1.831 Freddie Mac Strips 390, Class C17, 4,500 %, fällig 15.11.2052	387	0,08
2.544 CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B4, 144A, 4,532 %, fällig 01.08.2057 *	2.381	0,46	3.725 FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Class B, 144A, 4,748 %, fällig 25.02.2038 *	2.167	0,42
– CSMC 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	–	–	693 Government National Mortgage Association, Series 2010 102, Class IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *	–	–
7.657 CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Class 11A2, 2,066 %, fällig 25.08.2036 **	844	0,16	1.727 Government National Mortgage Association, Series 2010 13, Class IO, 0,000 %, fällig 16.11.2051 *	–	–
83 CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Series 2006 1R, Class 1A2, 144A, 7,321 %, fällig 27.07.2036 *	81	0,02	15.968 Government National Mortgage Association, Series 2011 95, Class IO, 0,005 %, fällig 16.04.2051 *	1	–
4.307 CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Class B5, 144A, 3,619 %, fällig 25.10.2043 *	2.975	0,58	7.479 Government National Mortgage Association, Series 2012 114, Class IO, 0,628 %, fällig 16.01.2053 *	117	0,02
6.132 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,794 %, fällig 15.07.2032 *	5.964	1,16	2.140 Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,012 %, fällig 16.02.2046 *	27	0,01
4.000 CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 7,971 %, fällig 15.08.2035 *	3.800	0,74	4.868 Government National Mortgage Association, Series 2014 16, Class IO, 0,404 %, fällig 16.06.2055 *	61	0,01
517 DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Class 2A2B, 5,268 %, fällig 19.01.2045 *	357	0,07	5.981 Government National Mortgage Association, Series 2014 171, Class IO, 0,311 %, fällig 16.11.2055 *	41	0,01
2.199 DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Class 2A1B, 5,108 %, fällig 19.09.2045 *	1.812	0,35	610 Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,159 %, fällig 16.02.2048 *	3	–
420 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 2A1B, 4,608 %, fällig 19.04.2047 *	403	0,08	3.195 Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,589 %, fällig 16.09.2055 *	62	0,01
2.600 EFMT 2025-INV1, Series 2025 INV1, Class B1, 144A, 7,185 %, fällig 25.03.2070 *	2.629	0,51	625 Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Class SB, 1,674 %, fällig 16.10.2046 *	77	0,02
2.645 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Class 1B, 16,216 %, fällig 25.08.2028 *	2.886	0,56	568 Government National Mortgage Association, Series 2016 51, Class NS, 1,624 %, fällig 20.04.2046 *	66	0,01
2.426 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Class 1B, 14,716 %, fällig 25.01.2029 *	2.683	0,52	2.887 Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 1,824 %, fällig 20.09.2048 *	341	0,07
4.860 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Class 1B, 13,716 %, fällig 25.04.2029 *	5.408	1,05	11.642 Government National Mortgage Association, Series 2020 89, Class IA, 1,168 %, fällig 16.04.2062 *	877	0,17
3.875 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 1B1, 8,216 %, fällig 25.03.2031 *	4.187	0,81	4.661 Government National Mortgage Association, Series 2022 202, Class Z, 3,000 %, fällig 16.10.2063 *	2.684	0,52
1.303 Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Class SC, 1,734 %, fällig 25.11.2047 *	122	0,02	2.761 Government National Mortgage Association, Series 2023 16, Class Z, 3,500 %, fällig 16.07.2063 *	1.762	0,34
3.712 Fannie Mae REMICS, Series 2020 45, Class AI, 4,000 %, fällig 25.07.2050	748	0,15	1.280 Greystone CRE Notes 2024-HC3, Series 2024 HC3, Class D, 144A, 9,644 %, fällig 15.03.2041 *	1.282	0,25
3.590 Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 7,702 %, fällig 25.07.2041 *	3.602	0,70	25.528 GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class D, 144A, 10,859 %, fällig 15.09.2031 *	3.109	0,60
19.370 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Class X3, 1,616 %, fällig 25.01.2044 *	238	0,05	2.886 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Series 2015 GC28, Class D, 144A, 4,478 %, fällig 10.02.2048 *	2.752	0,53
19.739 Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	19.835	3,85	2.500 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC30, Series 2015 GC30, Class D, 3,384 %, fällig 10.05.2050	1.973	0,38
19.193 Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	19.288	3,74	1.500 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Serie 2015 GC32, Klasse D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	1.426	0,28
2.893 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	2.682	0,52	4.800 GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Series 2006 1F, Class 6A1, 4,834 %, fällig 25.02.2036 *	478	0,09

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
42 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 2A1A, 4,968 %, fällig 19.03.2035 *	42	0,01	3.000 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class B2, 144A, 4,051 %, fällig 27.11.2056 *	2.438	0,47
370 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 2A1A, 4,868 %, fällig 19.05.2035 *	355	0,07	650 New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL1, Series 2024 RTL1, Class A2, 144A, 7,101 %, fällig 25.03.2039	656	0,13
137 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 2A1A, 4,908 %, fällig 19.06.2035 *	133	0,03	2.150 New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL1, Series 2024 RTL1, Class M1, 144A, 8,520 %, fällig 25.03.2039 *	2.171	0,42
1.319 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 6,186 %, fällig 19.09.2035 *	906	0,18	2.750 NYMT Loan Trust Series 2024-BPL2, Series 2024 BPL2, Class A2, 144A, 6,811 %, fällig 25.05.2039	2.780	0,54
376 HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1A, 4,841 %, fällig 19.11.2036 *	326	0,06	3.603 OBX 2024-NQM15 Trust, Series 2024 NQM15, Class A3, 144A, 5,722 %, fällig 25.10.2064	3.610	0,70
500 HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class E, 144A, 7,376 %, fällig 16.06.2036 *	479	0,09	497 Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class M1, 4,989 %, fällig 25.04.2036 *	1.153	0,22
2.931 HOMES 2025-NQM1 Trust, Series 2025 NQM1, Class A3, 144A, 5,961 %, fällig 25.01.2070	2.936	0,57	2.500 PRPM 2025-RCF1 LLC, Series 2025 RCF1, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.02.2055	2.468	0,48
516 Impac CMB Trust Series 2005-1, Series 2005 1, Class M1, 5,124 %, fällig 25.04.2035 *	482	0,09	556 RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Class 1A1, 4,684 %, fällig 25.02.2036 *	360	0,07
1.333 Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class A2, 5,034 %, fällig 25.08.2035 *	1.197	0,23	758 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Series 2006 R2, Class AF1, 144A, 4,854 %, fällig 25.07.2036 *	709	0,14
701 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2B, 6,084 %, fällig 25.08.2036 *	699	0,14	3.081 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Serie 2006 A7CB, Klasse 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036	2.323	0,45
585 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Class 1A1, 4,224 %, fällig 25.08.2035 *	274	0,05	235 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2, Class 1A1, 7,315 %, fällig 25.03.2034 *	220	0,04
469 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Class 2A1B, 5,214 %, fällig 25.02.2035 *	348	0,07	45 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 1A1, 4,794 %, fällig 25.07.2046 *	39	0,01
1.747 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 5,094 %, fällig 25.04.2035 *	1.334	0,26	2.485 Towd Point Mortgage Trust 2016-4, Series 2016 4, Class B5, 144A, 4,013 %, fällig 25.07.2056 *	1.814	0,35
2.225 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 8,464 %, fällig 15.10.2032 *	2.210	0,43	3.612 Towd Point Mortgage Trust 2017-3, Series 2017 3, Class B5, 144A, 3,898 %, fällig 25.07.2057 *	2.469	0,48
2.250 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class F, 144A, 9,764 %, fällig 15.10.2032 *	2.079	0,40	7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class B2, 144A, 3,307 %, fällig 25.06.2058 *	5.106	0,99
4.022 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Class D, 144A, 8,193 %, fällig 15.05.2028 *	3.164	0,61	1.250 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,138 %, fällig 15.12.2051 *	1.174	0,23
3.070 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Series 2015 JP1, Class C, 4,721 %, fällig 15.01.2049 *	2.780	0,54	4.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class F, 144A, 8,180 %, fällig 15.02.2032 *	3.819	0,74
1.800 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144A, 7,952 %, fällig 05.07.2033 *	817	0,16	2.266 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	2.277	0,44
6.574 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144A, 9,176 %, fällig 15.12.2036 **	13	–	2.770 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class B1, 144A, 8,098 %, fällig 25.05.2068 *	2.794	0,54
6.867 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144A, 11,676 %, fällig 15.12.2036 **	1	–	2.750 Verus Securitization Trust 2024-1, Series 2024 1, Class B1, 144A, 7,909 %, fällig 25.01.2069 *	2.774	0,54
4.000 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Series 2021 NYMZ, Class M, 144A, 11,926 %, fällig 15.06.2026 *	846	0,16	1.412 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class B1, 144A, 7,643 %, fällig 25.06.2069 *	1.444	0,28
8.196 JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class AX1, 144A, 0,215 %, fällig 25.10.2048 **	53	0,01	2.120 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class B2, 144A, 8,046 %, fällig 25.06.2069 *	2.122	0,41
1.395 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Class B1, 6,044 %, fällig 25.07.2034 *	1.308	0,25	1.180 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	1.192	0,23
1.063 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Class B1, 6,636 %, fällig 25.09.2034 *	955	0,19	3.225 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Class B1, 5,349 %, fällig 25.08.2045 *	2.801	0,54
769 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 1A1F, 144A, 4,784 %, fällig 25.05.2035 *	382	0,07	834 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9, Class B1, 5,379 %, fällig 25.07.2045 *	724	0,14
1.725 MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class E, 144A, 7,228 %, fällig 16.10.2036 *	1.697	0,33	1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class B, 144A, 6,415 %, fällig 14.09.2022 *	1.238	0,24
2.510 MF1 2024-FL16, Series 2024 FL16, Class A, 144A, 5,853 %, fällig 18.11.2039 *	2.522	0,49	2.500 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,062 %, fällig 15.05.2048 *	2.098	0,41
1.395 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class D, 144A, 5,620 %, fällig 18.02.2040 *	1.397	0,27	1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Class D, 144A, 3,764 %, fällig 15.09.2057 *	645	0,13
1.270 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class E, 144A, 7,041 %, fällig 18.02.2040 *	1.272	0,25	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 454.222 \$)	386.365	74,99
5.000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Class D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	3.769	0,73	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 1,27 % (29. Februar 2024: 1,23 %)		
3.742 Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2, Series 2016 BNK2, Class B, 3,485 %, fällig 15.11.2049	3.202	0,62	1.550 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	1.563	0,30
1.157 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1, 5,034 %, fällig 25.01.2035 *	1.056	0,21	5.000 Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, fällig 15.01.2026	4.990	0,97
3.260 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Series 2006 8AR, Class 1A3, 4,754 %, fällig 25.06.2036 *	642	0,12		6.553	1,27
455 Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 11,159 %, fällig 25.04.2046 *	456	0,09	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.318 \$)	6.553	1,27
3.508 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	2.275	0,44	Schuldscheindarlehen – 3,05 % (29. Februar 2024: 3,13 %)		
4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	2.334	0,45	30.000 American Dream, –%, fällig 30.06.2028 **†∞	168	0,03
3.000 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Series 2022 JERI, Class G, 144A, 11,920 %, fällig 15.01.2039 *	2.268	0,44	1.613 Freehand Hotel, 8,508 %, fällig 06.03.2025 **∞	1.609	0,31
2.923 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Series 2016 4A, Class B5, 144A, 4,754 %, fällig 25.11.2056 *	2.700	0,52	2.935 Freehand Hotel, 8,508 %, fällig 06.03.2025 **∞	2.928	0,57
			5.452 Freehand Hotel, 8,508 %, fällig 06.03.2025 **∞	5.440	1,06
			5.551 Sono Retail Loan, 7,687 %, fällig 06.03.2025 **∞	5.540	1,08
			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 45.461 \$)	15.685	3,05
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,07 % (29. Februar 2024: 4,09 %)		
			5.530 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.530	1,07
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5.530 \$)	5.530	1,07

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Real Estate Investment Trusts – 1,89 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
USA – 1,89 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
165 AGNC Investment Corp, Series F *	4.171	0,81
139 Chimera Investment Corp, Series C *	3.297	0,64
91 MFA Financial Inc, Series C *	2.276	0,44
	9.744	1,89
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 9.235 \$)	9.744	1,89
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 628.011 \$)	512.078	99,39
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	7	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	512.085	99,39
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
Futures – -0,21 % (29. Februar 2024: -0,06 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.088	-0,21
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.088	-0,21
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	510.997	99,18
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	4.205	0,82
Gesamtnettvermögen	515.202 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 329.843.000 \$ und machten 64,01 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.
- † 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.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,01
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,04
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,07
Derivative Finanzinstrumente	–
Sonstige Vermögenswerte	0,88
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 12	Verkauf USD 13	\$ –
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 1.278	Verkauf USD 1.320	7
14. März 2025	BNY	Kauf CHF 1	Verkauf USD –	–
14. März 2025	BNY	Kauf CHF 65	Verkauf USD 72	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 12 \$)				\$ 7
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -6 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 6 \$)				\$ 7

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-210	\$ -23.993	\$ -574
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-152	-17.950	-303
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	-57	-7.075	-211
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 166 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -306 \$)				-1.088
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -140 \$)				\$ -1.088

[^] 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 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 1,40 % (29. Februar 2024: 1,44 %)					
1.190 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	1.042	0,09	346 Fannie Mae Pool '836398', 6,645 %, fällig 01.10.2035 *	354	0,03
1.343 FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig 30.10.2053	1.440	0,12	5 Fannie Mae Pool '836852', 6,691 %, fällig 01.10.2035 *	5	–
4.314 Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Serie 2023 3C, Klasse A, 144A, 6,500 %, fällig 20.07.2055	4.314	0,35	5 Fannie Mae Pool '843823', 6,717 %, fällig 01.11.2035 *	5	–
2.556 Home Partners of America 2021-3 Trust, Serie 2021 3, Klasse A, 144A, 2,200 %, fällig 17.01.2041	2.366	0,19	69 Fannie Mae Pool '843997', 6,585 %, fällig 01.11.2035 *	70	0,01
1.944 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Serie 2021 2GS, Klasse B, 144A, 2,790 %, fällig 20.03.2048	1.545	0,13	18 Fannie Mae Pool '865915', 6,747 %, fällig 01.03.2036 *	18	–
1.883 SBA Small Business Investment Cos, Serie 2023 10A, Klasse 1, 5,168 %, fällig 10.03.2033	1.928	0,16	453 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01.10.2044	448	0,04
2.174 SBA Small Business Investment Cos, Series 2023 10B, Class 1, 5,688 %, fällig 10.09.2033	2.282	0,19	13 Fannie Mae Pool '902663', 6,000 %, fällig 01.11.2036	14	–
750 SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Serie 2023 C, Klasse B, 144A, 6,360 %, fällig 15.11.2052	795	0,06	3 Fannie Mae Pool '909856', 6,000 %, fällig 01.03.2037	3	–
1.472 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Serie 2021 1A, Klasse A3, 144A, 2,860 %, fällig 20.06.2051	1.370	0,11	1 Fannie Mae Pool '974763', 4,500 %, fällig 01.04.2038	1	–
Summe Forderungenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 17.617 \$)	17.082	1,40	3 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01.08.2038	4	–
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 98,39 % (29. Februar 2024: 98,31 %)					
53.082 BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8, Class XA, 0,707 %, fällig 15.11.2050 *	830	0,07	47 Fannie Mae Pool 'AA8438', 4,500 %, fällig 06.01.2039	47	–
2.400 BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	2.330	0,19	901 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, fällig 11.01.2041	891	0,07
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	2.145	0,18	317 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, fällig 06.01.2042	306	0,03
4.050 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 5,859 %, fällig 15.07.2035 *	4.047	0,33	28 Fannie Mae Pool 'AB7668', 3,000 %, fällig 01.01.2043	25	–
340 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 5,328 %, fällig 15.02.2038 *	339	0,03	167 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, fällig 04.01.2033	160	0,01
1.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	970	0,08	10 Fannie Mae Pool 'AD3336', 5,500 %, fällig 04.01.2040	10	–
1.062 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	1.060	0,09	3 Fannie Mae Pool 'AD4567', 5,500 %, fällig 04.01.2040	3	–
1.769 CSMC 2021-NQM8, Series 2021 NQM8, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig 25.10.2066 *	1.603	0,13	4 Fannie Mae Pool 'AD4598', 5,500 %, fällig 05.01.2040	5	–
963 Fannie Mae Interest Strip 406, Class 2, 4,000 %, fällig 25.02.2041	163	0,01	9 Fannie Mae Pool 'AD4614', 5,500 %, fällig 06.01.2040	9	–
224 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 9, 5,000 %, fällig 25.02.2041 *	36	–	6 Fannie Mae Pool 'AD8281', 5,500 %, fällig 07.01.2040	6	–
486 Fannie Mae Interest Strip 407, Klasse C10, 5,000 %, fällig 25.01.2038	74	0,01	19 Fannie Mae Pool 'AD8326', 5,500 %, fällig 07.01.2040	19	–
316 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	47	–	31 Fannie Mae Pool 'AH5036', 5,500 %, fällig 02.01.2041	31	–
1.794 Fannie Mae Interest Strip 417, Klasse C5, 3,500 %, fällig 25.02.2043	308	0,03	14 Fannie Mae Pool 'AH9785', 5,500 %, fällig 04.01.2041	15	–
4.267 Fannie Mae Interest Strip 418, Klasse C15, 3,500 %, fällig 25.08.2043	715	0,06	24 Fannie Mae Pool 'AJ9532', 5,500 %, fällig 09.01.2041	24	–
1.530 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C21, 2,000 %, fällig 25.03.2050	201	0,02	14 Fannie Mae Pool 'AJ2033', 5,500 %, fällig 10.01.2041	14	–
14.706 Fannie Mae Interest Strip 427, Klasse C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	2.365	0,19	25 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, fällig 11.01.2041	25	–
808 Fannie Mae Interest Strip 428, Class C14, 2,500 %, fällig 25.01.2048	91	0,01	67 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, fällig 09.01.2041	67	0,01
1.582 Fannie Mae Interest Strip 429, Class C10, 1,500 %, fällig 25.04.2037	85	0,01	175 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, fällig 04.01.2037	185	0,02
3.430 Fannie Mae Interest Strip 435, Class C28, 3,500 %, fällig 25.09.2052	642	0,05	2.999 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	2.797	0,23
12.527 Fannie Mae Interest Strip 440, Class C50, 4,500 %, fällig 25.10.2053	2.835	0,23	28 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 12.01.2042	26	–
31.300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	27.270	2,23	1.003 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 05.01.2040	1.055	0,09
4.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	4.132	0,34	96 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01.01.2044	94	0,01
14.600 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	14.620	1,20	3.964 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01.05.2045	3.804	0,31
8.100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	8.234	0,67	721 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, fällig 12.01.2045	688	0,06
6.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,500 % ±	6.182	0,51	680 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, fällig 08.01.2035	637	0,05
– Fannie Mae Pool '252875', 8,000 %, fällig 01.11.2029	–	–	83 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 11.01.2046	78	0,01
– Fannie Mae Pool '253184', 8,000 %, fällig 01.04.2030	–	–	84 Fannie Mae Pool 'AO4102', 4,000 %, fällig 06.01.2042	81	0,01
– Fannie Mae Pool '253399', 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	285 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 10.01.2042	275	0,02
– Fannie Mae Pool '253438', 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	757 Fannie Mae Pool 'AQ6295', 3,500 %, fällig 12.01.2032	735	0,06
– Fannie Mae Pool '253598', 8,500 %, fällig 01.12.2030	–	–	49 Fannie Mae Pool 'AQ7130', 3,500 %, fällig 12.01.2032	47	–
– Fannie Mae Pool '535270', 8,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	192 Fannie Mae Pool 'AQ7270', 3,500 %, fällig 12.01.2032	185	0,02
4 Fannie Mae Pool '535299', 7,500 %, fällig 01.05.2030	4	–	255 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, fällig 01.01.2043	232	0,02
– Fannie Mae Pool '535332', 8,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	231 Fannie Mae Pool 'AQ7864', 3,500 %, fällig 12.01.2032	223	0,02
– Fannie Mae Pool '535351', 8,000 %, fällig 01.06.2030	–	–	37 Fannie Mae Pool 'AQ7869', 3,500 %, fällig 11.01.2032	36	–
– Fannie Mae Pool '535435', 8,500 %, fällig 01.08.2030	–	–	101 Fannie Mae Pool 'AQ7913', 3,500 %, fällig 12.01.2032	97	0,01
– Fannie Mae Pool '535608', 9,500 %, fällig 01.04.2030	–	–	110 Fannie Mae Pool 'AQ8677', 3,500 %, fällig 12.01.2032	106	0,01
2 Fannie Mae Pool '535996', 7,500 %, fällig 01.06.2031	2	–	79 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, fällig 01.01.2043	72	0,01
– Fannie Mae Pool '537715', 8,500 %, fällig 01.09.2030	–	–	257 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, fällig 01.01.2043	233	0,02
14 Fannie Mae Pool '545189', 7,500 %, fällig 01.08.2031	14	–	126 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 06.01.2043	113	0,01
11 Fannie Mae Pool '545190', 7,500 %, fällig 01.08.2031	12	–	299 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 07.01.2043	269	0,02
1 Fannie Mae Pool '545612', 8,000 %, fällig 01.04.2032	1	–	432 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, fällig 09.01.2033	419	0,03
1 Fannie Mae Pool '545990', 7,500 %, fällig 01.04.2031	1	–	154 Fannie Mae Pool 'AS0469', 4,000 %, fällig 09.01.2033	152	0,01
– Fannie Mae Pool '546591', 8,500 %, fällig 01.06.2030	–	–	86 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, fällig 12.01.2033	82	0,01
1 Fannie Mae Pool '548965', 8,500 %, fällig 01.07.2030	1	–	2.794 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01.01.2045	2.675	0,22
6 Fannie Mae Pool '555676', 7,500 %, fällig 01.12.2032	6	–	1.167 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, fällig 02.01.2045	1.152	0,09
7 Fannie Mae Pool '745248', 7,500 %, fällig 01.08.2034	7	–	344 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig 12.01.2045	319	0,03
85 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, fällig 01.07.2036	89	0,01	238 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01.01.2046	221	0,02
			192 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01.01.2046	177	0,01
			210 Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, fällig 04.01.2047	200	0,02
			135 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 01.06.2047	133	0,01
			155 Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, fällig 06.01.2033	149	0,01
			2.711 Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, fällig 04.01.2043	2.549	0,21
			54 Fannie Mae Pool 'AU4395', 4,000 %, fällig 10.01.2033	53	–
			23 Fannie Mae Pool 'AU4397', 4,000 %, fällig 10.01.2033	22	–
			282 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	254	0,02
			63 Fannie Mae Pool 'AU7248', 4,000 %, fällig 10.01.2033	62	0,01
			60 Fannie Mae Pool 'AU9562', 4,000 %, fällig 10.01.2033	59	–
			79 Fannie Mae Pool 'AU9567', 4,000 %, fällig 10.01.2033	77	0,01
			61 Fannie Mae Pool 'AU9570', 4,000 %, fällig 10.01.2033	59	–
			20 Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, fällig 03.01.2044	20	–
			47 Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, fällig 01.01.2034	46	–
			145 Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, fällig 01.01.2034	139	0,01
			178 Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, fällig 01.01.2034	171	0,01
			223 Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, fällig 01.01.2034	215	0,02
			1.808 Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, fällig 09.01.2035	1.778	0,15
			2.205 Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500 %, fällig 10.01.2056	1.999	0,16
			606 Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, fällig 03.01.2057	547	0,04
			1.604 Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000 %, fällig 10.01.2046	1.627	0,13
			3.206 Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, fällig 11.01.2045	3.253	0,27
			794 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 06.01.2057	747	0,06
			1.487 Fannie Mae Pool 'BF0222', 4,500 %, fällig 09.01.2057	1.440	0,12
			972 Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500 %, fällig 05.01.2058	881	0,07
			1.751 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 08.01.2058	1.695	0,14
			631 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	609	0,05
			76 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, fällig 04.01.2048	72	0,01
			885 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	819	0,07
			254 Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500 %, fällig 05.01.2048	249	0,02
			26 Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, fällig 03.01.2048	24	–

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)				1.083	Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, fällig 01.01.2051	918	0,08
665	Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500 %, fällig 01.08.2048	650	0,05	53	Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 01.02.2051	45	–
326	Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000 %, fällig 08.01.2047	310	0,03	96	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	82	0,01
980	Fannie Mae Pool 'BM3929', 3,500 %, fällig 07.01.2032	954	0,08	238	Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, fällig 01.11.2048	212	0,02
909	Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, fällig 01.03.2047	822	0,07	131	Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 03.01.2051	112	0,01
151	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 03.01.2043	143	0,01	2.023	Fannie Mae Pool 'FM7167', 4,500 %, fällig 08.01.2050	1.972	0,16
89	Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500 %, fällig 01.10.2048	87	0,01	12.410	Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, fällig 05.01.2051	10.957	0,90
217	Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	203	0,02	6.064	Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, fällig 06.01.2051	5.131	0,42
1.569	Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, fällig 01.09.2048	1.544	0,13	212	Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000 %, fällig 05.01.2051	188	0,02
688	Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, fällig 04.01.2048	613	0,05	238	Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 06.01.2051	202	0,02
102	Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500 %, fällig 12.01.2048	100	0,01	74	Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, fällig 06.01.2051	62	0,01
603	Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, fällig 01.01.2052	494	0,04	67	Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000 %, fällig 06.01.2051	60	–
88	Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000 %, fällig 11.01.2049	78	0,01	192	Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 06.01.2051	165	0,01
12.543	Fannie Mae Pool 'BO5026', 3,000 %, fällig 12.01.2049	11.238	0,92	753	Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, fällig 01.01.2051	639	0,05
131	Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	117	0,01	938	Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01.07.2051	797	0,07
727	Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, fällig 02.01.2050	643	0,05	740	Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	633	0,05
544	Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, fällig 06.01.2051	462	0,04	647	Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 01.07.2051	552	0,05
871	Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, fällig 04.01.2050	805	0,07	252	Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, fällig 06.01.2051	224	0,02
3.364	Fannie Mae Pool 'BP7395', 1,500 %, fällig 10.01.2040	2.797	0,23	1.335	Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, fällig 03.01.2040	1.251	0,10
518	Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, fällig 08.01.2050	457	0,04	2.523	Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, fällig 08.01.2038	2.392	0,20
281	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 11.01.2050	239	0,02	1.096	Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 04.01.2050	972	0,08
64	Fannie Mae Pool 'BR0001', 2,500 %, fällig 12.01.2050	54	–	1.301	Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 02.01.2050	1.157	0,09
645	Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, fällig 05.01.2051	550	0,05	2.719	Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, fällig 09.01.2051	2.385	0,20
75	Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, fällig 01.08.2051	66	0,01	2.556	Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, fällig 01.10.2051	2.165	0,18
133	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 01.02.2051	108	0,01	359	Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01.10.2051	304	0,02
129	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 01.02.2051	104	0,01	69	Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, fällig 09.01.2051	59	–
62	Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	–	420	Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, fällig 01.10.2051	373	0,03
60	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	49	–	2.274	Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, fällig 10.01.2041	1.963	0,16
187	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	151	0,01	1.585	Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	1.406	0,12
345	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 03.01.2051	280	0,02	2.014	Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, fällig 06.01.2038	1.902	0,16
324	Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 03.01.2051	263	0,02	138	Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500 %, fällig 01.11.2051	117	0,01
291	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 03.01.2051	237	0,02	14.041	Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, fällig 01.11.2051	11.454	0,94
580	Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 03.01.2051	471	0,04	4.506	Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, fällig 01.11.2051	4.152	0,34
293	Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, fällig 03.01.2051	238	0,02	4.866	Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, fällig 03.01.2037	4.623	0,38
490	Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 03.01.2051	399	0,03	292	Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500 %, fällig 12.01.2051	248	0,02
789	Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 03.01.2051	642	0,05	919	Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, fällig 09.01.2051	779	0,06
140	Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, fällig 04.01.2051	114	0,01	192	Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, fällig 11.01.2050	171	0,01
65	Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, fällig 04.01.2051	53	–	1.188	Fannie Mae Pool 'FS0316', 1,500 %, fällig 11.01.2041	995	0,08
65	Fannie Mae Pool 'BR7745', 2,000 %, fällig 04.01.2051	53	–	302	Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, fällig 01.01.2052	268	0,02
157	Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500 %, fällig 04.01.2051	134	0,01	238	Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, fällig 01.01.2052	193	0,02
75	Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, fällig 04.01.2051	61	–	1.939	Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01.02.2052	1.714	0,14
66	Fannie Mae Pool 'BR8518', 2,000 %, fällig 04.01.2051	54	–	394	Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 01.07.2051	334	0,03
264	Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500 %, fällig 05.01.2051	225	0,02	2.071	Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.758	0,14
421	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 01.07.2051	357	0,03	1.417	Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.202	0,10
608	Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 01.07.2051	516	0,04	1.250	Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	1.016	0,08
492	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 01.08.2051	418	0,03	694	Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 01.02.2052	566	0,05
308	Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, fällig 01.08.2051	261	0,02	5.307	Fannie Mae Pool 'FS0835', 2,500 %, fällig 03.01.2052	4.487	0,37
214	Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 01.08.2051	182	0,01	458	Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 03.01.2052	409	0,03
2.707	Fannie Mae Pool 'BT9482', 2,500 %, fällig 12.01.2051	2.288	0,19	293	Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, fällig 01.01.2045	264	0,02
13.762	Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000 %, fällig 01.11.2051	11.188	0,92	3.292	Fannie Mae Pool 'FS1538', 3,000 %, fällig 04.01.2052	2.900	0,24
755	Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	639	0,05	374	Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, fällig 01.11.2048	337	0,03
2.927	Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500 %, fällig 01.11.2051	2.479	0,20	694	Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, fällig 11.01.2050	588	0,05
70	Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, fällig 12.01.2051	61	0,01	1.119	Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 04.01.2052	952	0,08
337	Fannie Mae Pool 'BU8670', 4,500 %, fällig 05.01.2052	326	0,03	5.970	Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 06.01.2049	5.489	0,45
3.191	Fannie Mae Pool 'BW5810', 5,000 %, fällig 08.01.2052	3.154	0,26	578	Fannie Mae Pool 'FS3009', 2,000 %, fällig 05.01.2042	499	0,04
62	Fannie Mae Pool 'BX6441', 6,500 %, fällig 02.01.2053	65	0,01	4.575	Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500 %, fällig 10.01.2052	4.617	0,38
800	Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500 %, fällig 02.01.2053	830	0,07	1.508	Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, fällig 01.01.2053	1.538	0,13
116	Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 12.01.2047	107	0,01	1.107	Fannie Mae Pool 'FS3571', 3,500 %, fällig 08.01.2052	1.009	0,08
4.474	Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, fällig 12.01.2047	4.129	0,34	1.097	Fannie Mae Pool 'FS3589', 4,500 %, fällig 01.01.2050	1.085	0,09
988	Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500 %, fällig 06.01.2048	970	0,08	16.808	Fannie Mae Pool 'FS3756', 3,000 %, fällig 05.01.2051	14.869	1,22
819	Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, fällig 06.01.2050	723	0,06	10.415	Fannie Mae Pool 'FS3803', 5,500 %, fällig 01.01.2053	10.480	0,86
426	Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, fällig 06.01.2050	376	0,03	6.372	Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, fällig 01.10.2051	5.183	0,42
3.238	Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, fällig 01.10.2050	2.755	0,23	4.015	Fannie Mae Pool 'FS4270', 2,000 %, fällig 03.01.2052	3.256	0,27
1.520	Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 01.10.2051	1.335	0,11	1.975	Fannie Mae Pool 'FS4570', 5,000 %, fällig 12.01.2047	2.001	0,16
4.171	Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 01.11.2051	3.683	0,30	9.633	Fannie Mae Pool 'FS4875', 6,000 %, fällig 05.01.2053	9.846	0,81
2.560	Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	2.272	0,19	84	Fannie Mae Pool 'FS5708', 5,000 %, fällig 06.01.2053	84	0,01
2.068	Fannie Mae Pool 'CB2804', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.749	0,14	4.073	Fannie Mae Pool 'FS6000', 4,500 %, fällig 05.01.2050	3.985	0,33
1.974	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 03.01.2052	1.674	0,14	2.567	Fannie Mae Pool 'FS6691', 1,500 %, fällig 03.01.2042	2.120	0,17
6.246	Fannie Mae Pool 'CB4898', 5,000 %, fällig 10.01.2052	6.174	0,51	1.696	Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, fällig 12.01.2053	1.756	0,14
735	Fannie Mae Pool 'CB5156', 6,500 %, fällig 11.01.2052	767	0,06	3.674	Fannie Mae Pool 'FS7283', 4,500 %, fällig 09.01.2053	3.591	0,29
1.038	Fannie Mae Pool 'CB5497', 6,500 %, fällig 01.01.2053	1.082	0,09	347	Fannie Mae Pool 'FS7294', 5,500 %, fällig 05.01.2044	358	0,03
927	Fannie Mae Pool 'CB5500', 6,500 %, fällig 01.01.2053	961	0,08	999	Fannie Mae Pool 'FS7940', 4,500 %, fällig 09.01.2053	978	0,08
1.500	Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, fällig 01.01.2048	1.386	0,11	2.442	Fannie Mae Pool 'FS8027', 2,500 %, fällig 03.01.2052	2.066	0,17
58	Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500 %, fällig 02.01.2048	57	–	2.806	Fannie Mae Pool 'FS8124', 3,000 %, fällig 06.01.2052	2.474	0,20
744	Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, fällig 01.03.2047	693	0,06	11.748	Fannie Mae Pool 'FS8273', 1,500 %, fällig 01.02.2042	9.797	0,80
55	Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500 %, fällig 04.01.2049	54	–	24.279	Fannie Mae Pool 'FS8579', 2,000 %, fällig 08.01.2042	20.991	1,72
905	Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, fällig 05.01.2049	889	0,07	24	Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, fällig 11.01.2040	24	–
175	Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, fällig 01.09.2048	166	0,01	3	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	3	–
1.686	Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500 %, fällig 10.01.2044	1.664	0,14	7	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	7	–
341	Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, fällig 03.01.2050	332	0,03	4	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	4	–
59	Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500 %, fällig 10.01.2049	58	–	90	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	90	0,01
228	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01.11.2048	217	0,02	100	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	101	0,01
1.676	Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 01.09.2048	1.597	0,13	22	Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 01.12.2031	23	–
65	Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 05.01.2049	62	0,01	150	Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 09.01.2042	140	0,01
167	Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, fällig 04.01.2050	148	0,01	9	Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 09.01.2042	8	–
83	Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000 %, fällig 01.09.2050	74	0,01	37	Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig 02.01.2043	34	–
591	Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 01.10.2050	500	0,04	1.165	Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 03.01.2043	1.130	0,09

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)					
247 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 09.01.2043	242	0,02	6.959 Fannie Mae REMICS, Series 2021 33, Class AI, 2,500 %, fällig 25.05.2047	922	0,08
187 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01.10.2043	183	0,02	1.814 Fannie Mae REMICS, Series 2021 4, Class GI, 3,000 %, fällig 25.02.2051	309	0,03
119 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01.11.2043	117	0,01	22.444 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 42, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.11.2048	3.201	0,26
168 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01.12.2043	165	0,01	7.091 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 46, Klasse BI, 2,500 %, fällig 25.12.2048	1.019	0,08
334 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 07.01.2036	314	0,03	6.706 Fannie Mae REMICS, Series 2021 49, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	953	0,08
326 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01.12.2036	306	0,03	15.796 Fannie Mae REMICS, Series 2021 52, Class CI, 2,500 %, fällig 25.12.2047	2.238	0,18
3.111 Fannie Mae Pool 'MA4047', 2,000 %, fällig 06.01.2050	2.516	0,21	1.025 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 54, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	143	0,01
200 Fannie Mae Pool 'MA4175', 1,500 %, fällig 11.01.2040	166	0,01	8.379 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 59, Klasse TI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	1.270	0,10
573 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, fällig 12.01.2040	496	0,04	1.482 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 61, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.04.2049	220	0,02
406 Fannie Mae Pool 'MA4287', 2,000 %, fällig 03.01.2041	352	0,03	8.262 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class PI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	923	0,08
442 Fannie Mae Pool 'MA4342', 1,500 %, fällig 05.01.2041	368	0,03	754 Fannie Mae REMICS, Series 2021 62, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2047	112	0,01
656 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, fällig 07.01.2041	568	0,05	771 Fannie Mae REMICS, Series 2021 63, Class QI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	99	0,01
433 Fannie Mae Pool 'MA4447', 2,500 %, fällig 10.01.2041	379	0,03	22.195 Fannie Mae REMICS, Series 2021 76, Class PI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	2.518	0,21
1.207 Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, fällig 11.01.2041	1.035	0,08	20.937 Fannie Mae REMICS, Series 2021 8, Class DI, 3,500 %, fällig 25.03.2051	4.627	0,38
1.340 Fannie Mae Pool 'MA4500', 1,500 %, fällig 01.12.2041	1.122	0,09	2.481 Fannie Mae REMICS, Series 2021 89, Class AI, 2,500 %, fällig 25.04.2048	363	0,03
1.927 Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, fällig 01.12.2041	1.653	0,14	11.453 Fannie Mae REMICS, Serie 2021 91, Klasse IG, 2,500 %, fällig 25.01.2052	1.708	0,14
468 Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, fällig 01.02.2042	399	0,03	11.776 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 29, Klasse KZ, 1,500 %, fällig 25.06.2042	8.622	0,71
18.726 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig 01.03.2042	15.981	1,31	604 Fannie Mae REMICS, Serie 2022 57, Klasse BC, 4,000 %, fällig 25.09.2052	573	0,05
3.884 Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, fällig 04.01.2042	3.410	0,28	263 Fannie Mae-Aces, Serie 2016 M11, Klasse AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	237	0,02
659 Fannie Mae REMICS, Serie 2010 2, Klasse AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	93	0,01	11.818 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,155 %, fällig 25.06.2029 *	377	0,03
776 Fannie Mae REMICS, Series 2012 124, Class SD, 1,684 %, fällig 25.11.2042 *	84	0,01	12.874 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13, Class X1, 0,819 %, fällig 25.06.2034 *	426	0,03
1.134 Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 2,034 %, fällig 25.03.2042 *	137	0,01	36.886 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Class X1, 0,552 %, fällig 25.06.2029 *	693	0,06
465 Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,586 %, fällig 25.07.2036 *	555	0,05	4.821 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Class IO, 1,767 %, fällig 25.01.2029 *	235	0,02
592 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	624	0,05	33.429 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Class X1, 0,461 %, fällig 25.04.2032 *	717	0,06
2.634 Fannie Mae REMICS, Serie 2013 9, Klasse CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	2.693	0,22	4.170 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Class X1, 1,599 %, fällig 25.01.2037 *	329	0,03
122 Fannie Mae REMICS, Serie 2015 39, Klasse LZ, 3,000 %, fällig 25.06.2045	108	0,01	13.923 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31, Class X2, 1,212 %, fällig 25.12.2032 *	675	0,06
4.292 Fannie Mae REMICS, Serie 2016 48, Klasse IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	558	0,05	23 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig 01.01.2035	23	–
2.203 Fannie Mae REMICS, Serie 2017 74, Klasse PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	1.801	0,15	– Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, fällig 01.01.2039	–	–
2.959 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 3, Klasse IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	597	0,05	– Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, fällig 10.01.2027	–	–
996 Fannie Mae REMICS, Serie 2018 74, Klasse AB, 3,500 %, fällig 25.10.2048	919	0,08	– Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, fällig 07.01.2030	–	–
724 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 25, Klasse PI, 5,000 %, fällig 25.05.2048	142	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, fällig 09.01.2030	–	–
3.171 Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 1,585 %, fällig 25.07.2049 *	371	0,03	1 Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, fällig 12.01.2030	1	–
1.657 Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 1,584 %, fällig 25.08.2049 *	187	0,02	2 Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, fällig 08.01.2031	2	–
1.737 Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 1,584 %, fällig 25.08.2049 *	175	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, fällig 09.01.2031	–	–
3.081 Fannie Mae REMICS, Serie 2019 5, Klasse IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	579	0,05	1 Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, fällig 05.01.2027	1	–
1.019 Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Class NS, 1,534 %, fällig 25.10.2049 *	127	0,01	829 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig 02.01.2038	772	0,06
1.241 Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Class HS, 1,534 %, fällig 25.10.2049 *	132	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, fällig 09.01.2026	–	–
2.636 Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 1,534 %, fällig 25.10.2049 *	286	0,02	– Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, fällig 06.01.2027	–	–
1.063 Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Class SA, 1,484 %, fällig 25.05.2050 *	114	0,01	– Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, fällig 11.01.2026	–	–
7.888 Fannie Mae REMICS, Series 2020 45, Class AI, 4,000 %, fällig 25.07.2050	1.590	0,13	21 Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, fällig 08.01.2038	21	–
988 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 47, Klasse GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	597	0,05	1 Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, fällig 01.04.2038	1	–
604 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 57, Klasse TA, 2,000 %, fällig 25.04.2050	524	0,04	3 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	3	–
909 Fannie Mae REMICS, Series 2020 61, Class NI, 3,500 %, fällig 25.09.2050	152	0,01	73 Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, fällig 03.01.2039	77	0,01
651 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class AI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	110	0,01	177 Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, fällig 01.09.2039	188	0,02
1.446 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 62, Klasse BI, 2,000 %, fällig 25.09.2050	182	0,01	773 Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, fällig 03.01.2046	762	0,06
3.982 Fannie Mae REMICS, Series 2020 63, Class KI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	291	0,02			
2.232 Fannie Mae REMICS, Series 2020 67, Class IH, 2,000 %, fällig 25.09.2050	297	0,02			
1.978 Fannie Mae REMICS, Series 2020 71, Class IA, 2,000 %, fällig 25.03.2041	83	0,01			
138 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 74, Klasse EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	23	–			
11.668 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 88, Klasse GI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.620	0,13			
951 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	152	0,01			
7.886 Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.309	0,11			
5.606 Fannie Mae REMICS, Serie 2020 93, Klasse LI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	814	0,07			
1.129 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class NI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	171	0,01			

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)					
106 Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, fällig 03.01.2033	102	0,01	124 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 02.01.2051	101	0,01
965 Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, fällig 06.01.2040	989	0,08	63 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 02.01.2051	51	–
2.990 Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, fällig 12.01.2045	2.873	0,24	66 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig 03.01.2051	53	–
4.220 Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, fällig 09.01.2048	3.900	0,32	196 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, fällig 03.01.2051	159	0,01
7.328 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	6.561	0,54	138 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig 03.01.2051	113	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, fällig 05.01.2037	1	–	74 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig 03.01.2051	60	–
40 Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, fällig 02.01.2038	40	–	58 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig 03.01.2051	47	–
1 Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 3,500 %, fällig 01.01.2038	1	–	71 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig 03.01.2051	58	–
238 Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, fällig 10.01.2033	228	0,02	69 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig 04.01.2051	56	–
148 Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, fällig 12.01.2033	142	0,01	64 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, fällig 04.01.2051	52	–
143 Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, fällig 06.01.2044	138	0,01	143 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 05.01.2051	123	0,01
1.084 Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, fällig 05.01.2045	1.040	0,09	452 Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, fällig 06.01.2051	401	0,03
50 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	48	–	362 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01.07.2051	307	0,03
299 Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, fällig 11.01.2042	289	0,02	365 Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, fällig 01.08.2051	310	0,03
238 Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, fällig 11.01.2042	230	0,02	386 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig 01.08.2051	328	0,03
30 Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, fällig 12.01.2042	28	–	318 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig 01.08.2051	270	0,02
75 Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, fällig 12.01.2042	70	0,01	428 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01.08.2051	364	0,03
29 Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, fällig 01.01.2043	27	–	3.410 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	2.882	0,24
51 Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, fällig 01.01.2043	48	–	1.671 Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, fällig 01.09.2051	1.415	0,12
72 Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, fällig 01.01.2043	68	0,01	3.213 Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, fällig 01.10.2051	2.721	0,22
135 Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, fällig 02.01.2043	126	0,01	819 Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, fällig 01.11.2051	695	0,06
85 Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, fällig 02.01.2043	80	0,01	3.643 Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, fällig 01.12.2051	2.972	0,24
98 Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, fällig 02.01.2043	91	0,01	77 Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, fällig 01.11.2051	67	0,01
120 Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, fällig 02.01.2043	112	0,01	5.299 Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, fällig 01.12.2051	4.672	0,38
3.213 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	3.000	0,25	218 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig 01.01.2052	185	0,02
1.632 Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, fällig 02.01.2044	1.588	0,13	485 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig 01.02.2052	393	0,03
55.143 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Class X1, 0,654 %, fällig 25.04.2027 *	692	0,06	593 Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, fällig 01.02.2052	479	0,04
83.961 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Class X1, 0,340 %, fällig 25.09.2027 *	673	0,06	84 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig 01.02.2052	69	0,01
54.532 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Class XAM, 0,079 %, fällig 25.06.2028 *	218	0,02	471 Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, fällig 01.02.2052	381	0,03
57.720 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Class XAM, 0,072 %, fällig 25.08.2028 *	224	0,02	3.000 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.538	0,21
869 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, Class X1, 0,560 %, fällig 25.03.2029 *	18	–	245 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig 01.02.2052	208	0,02
8.208 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, Class X1, 1,519 %, fällig 25.01.2030 *	497	0,04	150 Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000 %, fällig 01.02.2052	132	0,01
11.471 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K110, Class X1, 1,692 %, fällig 25.04.2030 *	766	0,06	251 Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, fällig 01.02.2052	205	0,02
5.930 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K115, Class X1, 1,319 %, fällig 25.06.2030 *	341	0,03	1.617 Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500 %, fällig 01.08.2052	1.631	0,13
8.761 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, Class X1, 1,417 %, fällig 25.07.2030 *	530	0,04	2.166 Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500 %, fällig 01.08.2052	2.185	0,18
976 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, Class X1, 1,018 %, fällig 25.10.2030 *	44	–	4.783 Freddie Mac Pool 'QE8537', 5,000 %, fällig 01.08.2052	4.726	0,39
109.016 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Class X1, 0,768 %, fällig 25.12.2030 *	3.899	0,32	78 Freddie Mac Pool 'QF0921', 5,000 %, fällig 09.01.2052	77	0,01
3.573 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Class X1, 0,716 %, fällig 25.12.2030 *	122	0,01	1.720 Freddie Mac Pool 'QF3429', 5,500 %, fällig 01.11.2052	1.745	0,14
14.176 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Class X1, 0,507 %, fällig 25.08.2031 *	386	0,03	569 Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000 %, fällig 01.12.2052	584	0,05
63.951 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Class X1, 0,305 %, fällig 25.02.2032 *	1.228	0,10	11.208 Freddie Mac Pool 'QF5465', 5,000 %, fällig 01.12.2052	11.073	0,91
61.381 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Class X1, 0,297 %, fällig 25.03.2032 *	1.149	0,09	114 Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500 %, fällig 01.01.2053	118	0,01
85.092 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Class X1, 0,342 %, fällig 25.04.2032 *	1.862	0,15	134 Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500 %, fällig 01.01.2053	139	0,01
22.663 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Class X1, 0,250 %, fällig 25.07.2032 *	417	0,03	149 Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500 %, fällig 01.02.2053	155	0,01
28.438 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Class X1, 0,532 %, fällig 25.10.2031 *	808	0,07	179 Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500 %, fällig 01.03.2053	186	0,02
4.153 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 1515, Class X1, 1,508 %, fällig 25.02.2035 *	426	0,03	2.386 Freddie Mac Pool 'QF9586', 6,500 %, fällig 01.03.2053	2.485	0,20
6.697 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 154, Class X1, 0,353 %, fällig 25.01.2033 *	179	0,01	844 Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000 %, fällig 01.04.2053	834	0,07
57.974 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 155, Class X1, 0,265 %, fällig 25.04.2033 *	1.221	0,10	5.544 Freddie Mac Pool 'QI6769', 5,500 %, fällig 05.01.2054	5.578	0,46
39.986 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 160, Class X1, 0,209 %, fällig 25.08.2033 *	757	0,06	1.026 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01.09.2049	913	0,07
64.617 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 162, Class X1, 0,370 %, fällig 25.12.2033 *	1.929	0,16	5.628 Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, fällig 02.01.2050	5.012	0,41
4.562 Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,267 %, fällig 01.01.2049 *	4.411	0,36	352 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig 11.01.2050	287	0,02
2.018 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,009 %, fällig 01.11.2048 *	1.964	0,16	4.889 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 11.01.2050	4.168	0,34
387 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 3,047 %, fällig 01.11.2047 *	390	0,03	15.803 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig 01.12.2050	13.457	1,10
701 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,107 %, fällig 01.02.2050 *	695	0,06	1.559 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig 01.12.2050	1.319	0,11
79 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	71	0,01	1.950 Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000 %, fällig 02.01.2051	1.724	0,14
253 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 02.01.2050	232	0,02	496 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 02.01.2051	402	0,03
2.570 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig 02.01.2050	2.272	0,19	1.315 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 05.01.2051	1.067	0,09
104 Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, fällig 05.01.2050	93	0,01	387 Freddie Mac Pool 'RB0714', 2,000 %, fällig 01.12.2041	332	0,03
159 Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, fällig 05.01.2050	142	0,01	1.479 Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, fällig 05.01.2041	1.232	0,10
390 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 11.01.2050	332	0,03	7.268 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01.09.2041	6.228	0,51
276 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 11.01.2050	234	0,02	1.969 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	1.631	0,13
65 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 02.01.2051	53	–	250 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	207	0,02
			14.050 Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, fällig 01.12.2041	12.008	0,98
			476 Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig 02.01.2042	407	0,03
			7.483 Freddie Mac Pool 'RB5154', 2,500 %, fällig 01.04.2042	6.568	0,54
			9.392 Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, fällig 01.09.2041	8.258	0,68
			1.397 Freddie Mac Pool 'SC0319', 2,000 %, fällig 01.04.2042	1.204	0,10
			2.792 Freddie Mac Pool 'SC0399', 2,000 %, fällig 01.05.2042	2.415	0,20
			119 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 01.07.2047	113	0,01
			190 Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, fällig 01.07.2047	189	0,02
			124 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 04.01.2051	101	0,01
			293 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig 02.01.2051	259	0,02
			4.035 Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, fällig 02.01.2050	3.841	0,31
			768 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	651	0,05
			327 Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, fällig 01.04.2052	289	0,02
			1.273 Freddie Mac Pool 'SD1070', 3,500 %, fällig 01.04.2052	1.165	0,10
			1.564 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig 01.09.2050	1.534	0,13
			1.499 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	1.429	0,12
			6.229 Freddie Mac Pool 'SD1463', 3,000 %, fällig 01.12.2051	5.479	0,45
			3.824 Freddie Mac Pool 'SD1876', 5,500 %, fällig 01.11.2052	3.859	0,32
			8.454 Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, fällig 01.12.2052	8.542	0,70
			5.878 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig 01.12.2052	6.017	0,49
			771 Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, fällig 01.05.2053	800	0,07
			343 Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, fällig 01.09.2051	291	0,02
			12.459 Freddie Mac Pool 'SD3243', 3,000 %, fällig 01.12.2051	11.056	0,91
			3.797 Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000 %, fällig 01.06.2053	3.753	0,31
			5.460 Freddie Mac Pool 'SD3553', 6,000 %, fällig 07.01.2053	5.575	0,46
			4.243 Freddie Mac Pool 'SD3637', 6,000 %, fällig 08.01.2053	4.339	0,36
			166 Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, fällig 01.05.2053	165	0,01

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)							
2.467	Freddie Mac Pool 'SD3900', 5,500 %, fällig 08.01.2053	2.478	0,20	7.505	Freddie Mac REMICS 5027, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	1.237	0,10
888	Freddie Mac Pool 'SD4169', 6,500 %, fällig 10.01.2053	923	0,08	1.481	Freddie Mac REMICS 5027, Class HI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	207	0,02
260	Freddie Mac Pool 'SD5107', 6,000 %, fällig 07.01.2041	272	0,02	2.781	Freddie Mac REMICS 5038, Klasse PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	1.972	0,16
360	Freddie Mac Pool 'SD5179', 5,000 %, fällig 12.01.2044	365	0,03	126	Freddie Mac REMICS 5040, Klasse IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	18	–
13.385	Freddie Mac Pool 'SD5299', 6,000 %, fällig 04.01.2054	13.679	1,12	13.430	Freddie Mac REMICS 5050, Class IE, 2,000 %, fällig 25.12.2050	1.729	0,14
2.591	Freddie Mac Pool 'SD5311', 5,500 %, fällig 04.01.2054	2.605	0,21	2.022	Freddie Mac REMICS 5058, Klasse IL, 2,500 %, fällig 25.01.2051	284	0,02
5.262	Freddie Mac Pool 'SD5385', 6,000 %, fällig 02.01.2054	5.400	0,44	921	Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	156	0,01
6.634	Freddie Mac Pool 'SD5514', 4,500 %, fällig 07.01.2053	6.460	0,53	4.532	Freddie Mac REMICS 5070, Klasse NI, 2,000 %, fällig 25.02.2051	633	0,05
10.822	Freddie Mac Pool 'SD5625', 6,500 %, fällig 12.01.2053	11.208	0,92	8.155	Freddie Mac REMICS 5078, Class EI, 1,500 %, fällig 25.01.2051	846	0,07
16.718	Freddie Mac Pool 'SD6964', 3,000 %, fällig 01.04.2052	14.678	1,20	18.788	Freddie Mac REMICS 5085, Class IK, 2,500 %, fällig 25.03.2051	3.104	0,25
529	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	470	0,04	9.395	Freddie Mac REMICS 5092, Class IU, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.118	0,09
3.867	Freddie Mac Pool 'SD7523', 2,500 %, fällig 01.08.2050	3.290	0,27	3.059	Freddie Mac REMICS 5113, Klasse NI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	395	0,03
184	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	157	0,01	2.182	Freddie Mac REMICS 5126, Class HC, 1,250 %, fällig 25.11.2036	1.912	0,16
3.286	Freddie Mac Pool 'SD7526', 2,500 %, fällig 01.10.2050	2.796	0,23	10.351	Freddie Mac REMICS 5134, Klasse KI, 2,500 %, fällig 25.07.2048	1.436	0,12
580	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 02.01.2051	497	0,04	9.633	Freddie Mac REMICS 5135, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.05.2048	1.358	0,11
20.256	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	17.260	1,41	1.315	Freddie Mac REMICS 5149, Class NI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	200	0,02
1.103	Freddie Mac Pool 'SD7563', 4,500 %, fällig 01.05.2053	1.075	0,09	8.531	Freddie Mac REMICS 5160, Class IU, 2,500 %, fällig 25.11.2050	1.214	0,10
10.155	Freddie Mac Pool 'SD8222', 4,000 %, fällig 06.01.2052	9.535	0,78	8.620	Freddie Mac REMICS 5162, Klasse DI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	1.096	0,09
882	Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, fällig 01.05.2034	853	0,07	7.700	Freddie Mac REMICS 5169, Klasse PW, 2,000 %, fällig 25.09.2051	5.217	0,43
1.264	Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, fällig 01.06.2036	1.185	0,10	1.372	Freddie Mac REMICS 5173, Class LI, 2,500 %, fällig 25.05.2050	220	0,02
219	Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, fällig 01.03.2048	209	0,02	1.456	Freddie Mac REMICS 5174, Class CJ, 2,000 %, fällig 25.01.2050	1.238	0,10
1.992	Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, fällig 01.07.2046	1.841	0,15	7.200	Freddie Mac REMICS 5178, Klasse CY, 2,000 %, fällig 25.01.2042	4.990	0,41
10.169	Freddie Mac Pool 'ZM5659', 3,500 %, fällig 02.01.2048	9.331	0,76	14.819	Freddie Mac REMICS 5179, Class GI, 2,500 %, fällig 25.01.2052	2.495	0,20
320	Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, fällig 01.10.2042	298	0,02	8.193	Freddie Mac REMICS 5180, Class IP, 3,000 %, fällig 25.01.2052	1.658	0,14
712	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	664	0,05	709	Freddie Mac REMICS 5190, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	97	0,01
1.848	Freddie Mac Pool 'ZN0608', 3,500 %, fällig 01.02.2043	1.726	0,14	4.751	Freddie Mac REMICS 5202, Class NI, 3,000 %, fällig 25.08.2046	628	0,05
65	Freddie Mac Pool 'ZN0614', 3,500 %, fällig 01.02.2043	61	0,01	4.900	Freddie Mac REMICS 5209, Class EQ, 3,000 %, fällig 25.04.2052	3.728	0,31
54	Freddie Mac Pool 'ZN0628', 3,500 %, fällig 01.02.2043	50	–	1.303	Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	1.309	0,11
48	Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, fällig 01.12.2048	47	–	1.209	Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,652 %, fällig 25.12.2054 *	1.215	0,10
4	Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, fällig 01.07.2037	4	–	2.772	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA2, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 6,652 %, fällig 25.08.2033 *	2.863	0,23
108	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	111	0,01	1.215	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M1A, 144A, 7,302 %, fällig 25.06.2042 *	1.246	0,10
104	Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01.10.2032	101	0,01	956	Freddie Mac Strips 312, Class S1, 1,497 %, fällig 15.09.2043 *	95	0,01
189	Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, fällig 01.10.2046	169	0,01	3.754	Freddie Mac Strips 390, Class C17, 4,500 %, fällig 15.11.2052	793	0,06
32	Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, fällig 01.08.2048	32	–	733	Freddie Mac Strips 400, Class C9, 2,000 %, fällig 25.03.2052	98	0,01
1.814	Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, fällig 01.01.2043	1.648	0,14	10.519	Freddie Mac Strips 408, Class C37, 2,000 %, fällig 25.03.2052	1.419	0,12
641	Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig 01.03.2043	599	0,05	–	Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, fällig 15.12.2025	–	–
113	Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig 01.02.2044	105	0,01	–	Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, fällig 15.09.2025	–	–
116	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	105	0,01	–	Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, fällig 15.09.2027	–	–
29	Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, fällig 01.03.2049	28	–	–	Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, fällig 15.04.2028	–	–
100	Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01.06.2049	98	0,01	–	Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, fällig 15.08.2028	–	–
1.485	Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, fällig 06.01.2049	1.362	0,11	–	Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, fällig 15.09.2028	–	–
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Class VA, 5,291 %, fällig 15.06.2040 *	4.471	0,37	–	Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, fällig 15.05.2030	–	–
2.375	Freddie Mac REMICS 3998, Class DS, 2,047 %, fällig 15.02.2042 *	320	0,03	17	Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, fällig 15.10.2037	18	–
1.805	Freddie Mac REMICS 4134, Klasse IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	305	0,02	1	Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, fällig 15.03.2036	1	–
4.800	Freddie Mac REMICS 4377, Klasse UZ, 3,000 %, fällig 15.08.2044	3.910	0,32	2	Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, fällig 15.11.2036	2	–
50	Freddie Mac REMICS 4403, Klasse IG, 3,500 %, fällig 15.07.2032	1	–	–	Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, fällig 15.05.2038	–	–
1.088	Freddie Mac REMICS 4597, Class DA, 3,000 %, fällig 15.12.2045	1.000	0,08	–	Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
1.013	Freddie Mac REMICS 4715, Class JS, 1,697 %, fällig 15.08.2047 *	141	0,01	3	Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, fällig 15.02.2038	3	–
169	Freddie Mac REMICS 4759, Klasse MI, 4,000 %, fällig 15.09.2045	7	–	5	Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, fällig 15.02.2038	5	–
1.006	Freddie Mac REMICS 4808, Class SB, 1,747 %, fällig 15.07.2048 *	122	0,01	1	Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
168	Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	147	0,01	1	Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, fällig 15.04.2038	1	–
1.206	Freddie Mac REMICS 4856, Klasse IO, 5,000 %, fällig 15.01.2049	198	0,02	1	Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, fällig 15.05.2038	1	–
646	Freddie Mac REMICS 4870, Class ES, 1,547 %, fällig 15.04.2049 *	71	0,01	37	Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, fällig 15.04.2039	38	–
1.342	Freddie Mac REMICS 4882, Class S, 1,597 %, fällig 15.05.2049 *	127	0,01	7	Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, fällig 15.12.2038	7	–
2.121	Freddie Mac REMICS 4921, Class SN, 1,584 %, fällig 25.10.2049 *	281	0,02				
1.140	Freddie Mac REMICS 4936, Klasse YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049	941	0,08				
1.123	Freddie Mac REMICS 4962, Class SP, 1,584 %, fällig 25.03.2050 *	131	0,01				
2.906	Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	666	0,05				
14.417	Freddie Mac REMICS 4981, Class YI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	3.552	0,29				
2.964	Freddie Mac REMICS 4988, Klasse AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	1.825	0,15				
1.955	Freddie Mac REMICS 4995, Class IQ, 2,500 %, fällig 25.07.2050	286	0,02				
8.471	Freddie Mac REMICS 4995, Class QI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	1.263	0,10				
4.330	Freddie Mac REMICS 5000, Class IB, 2,500 %, fällig 25.07.2050	555	0,05				
3.563	Freddie Mac REMICS 5000, Class UI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	617	0,05				

[^] 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 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventarwert		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
208	Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, fällig 15.06.2039	211	0,02	75	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20.07.2046	70	0,01
97	Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	98	0,01	4.574	Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, fällig 20.10.2046	4.128	0,34
219	Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	221	0,02	647	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	583	0,05
1	Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, fällig 15.03.2028	1	–	316	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	302	0,02
–	Ginnie Mae I Pool '78100', 7,500 %, fällig 15.03.2029	–	–	1.817	Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, fällig 20.07.2047	1.686	0,14
34	Ginnie Mae I Pool '781590', 5,500 %, fällig 15.04.2033	34	–	65	Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, fällig 20.07.2047	62	0,01
227	Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, fällig 15.11.2033	232	0,02	96	Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig 20.08.2047	94	0,01
1	Ginnie Mae I Pool '782198', 6,000 %, fällig 15.10.2037	1	–	143	Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig 20.04.2048	140	0,01
247	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	233	0,02	106	Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	103	0,01
976	Ginnie Mae I Pool '787628', 4,500 %, fällig 15.01.2049	954	0,08	80	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, fällig 20.05.2048	80	0,01
105	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	96	0,01	15	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	14	–
128	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	117	0,01	111	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	109	0,01
37	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	34	–	1.501	Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig 20.08.2048	1.469	0,12
204	Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	186	0,02	33	Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20.09.2048	33	–
174	Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	157	0,01	189	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	189	0,02
1.354	Ginnie Mae I Pool 'B58462', 3,500 %, fällig 15.06.2050	1.274	0,10	51	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	50	–
5	Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig 20.10.2037	6	–	166	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	162	0,01
7	Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, fällig 20.06.2038	8	–	163	Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500 %, fällig 20.01.2049	165	0,01
533	Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, fällig 20.09.2038	569	0,05	80	Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500 %, fällig 20.02.2049	78	0,01
78	Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, fällig 20.12.2039	82	0,01	1.948	Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500 %, fällig 20.02.2049	1.984	0,16
89	Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig 20.01.2040	89	0,01	106	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	104	0,01
45	Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig 20.05.2040	45	–	403	Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500 %, fällig 20.03.2049	411	0,03
28	Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig 20.07.2040	29	–	10	Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20.04.2049	10	–
33	Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig 20.08.2040	33	–	400	Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500 %, fällig 20.04.2049	408	0,03
3	Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, fällig 20.08.2040	3	–	268	Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500 %, fällig 20.05.2049	274	0,02
67	Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig 20.09.2040	68	0,01	2.823	Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500 %, fällig 20.06.2049	2.881	0,24
28	Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, fällig 20.11.2040	28	–	176	Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500 %, fällig 20.10.2049	152	0,01
11	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20.01.2041	11	–	6.098	Ginnie Mae II Pool 'MA6221', 4,500 %, fällig 20.10.2049	5.955	0,49
6	Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20.01.2041	6	–	99	Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, fällig 20.01.2050	97	0,01
363	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	359	0,03	69	Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500 %, fällig 20.03.2050	64	0,01
799	Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20.07.2040	802	0,07	100	Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, fällig 20.04.2050	98	0,01
591	Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, fällig 20.04.2041	585	0,05	1.756	Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500 %, fällig 20.05.2050	1.621	0,13
56	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	53	–	167	Ginnie Mae II Pool 'MA6818', 2,000 %, fällig 20.08.2050	138	0,01
1.625	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20.07.2047	1.535	0,13	1.604	Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, fällig 20.09.2050	1.570	0,13
55	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	48	–	3.334	Ginnie Mae II Pool 'MA6931', 2,500 %, fällig 20.10.2050	2.868	0,24
459	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20.03.2051	372	0,03	2.001	Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, fällig 20.10.2050	1.959	0,16
7.743	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	6.851	0,56	3.242	Ginnie Mae II Pool 'MA6994', 2,000 %, fällig 20.11.2050	2.665	0,22
1.780	Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.572	0,13	12.194	Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	10.469	0,86
2.536	Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, fällig 20.11.2051	2.245	0,18	2.157	Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, fällig 20.04.2051	2.112	0,17
233	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	204	0,02	216	Ginnie Mae II Pool 'MA7471', 2,000 %, fällig 20.07.2051	178	0,01
1.285	Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.138	0,09	2.113	Ginnie Mae II Pool 'MA7472', 2,500 %, fällig 20.07.2051	1.813	0,15
1.128	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	1.104	0,09	146	Ginnie Mae II Pool 'MA7533', 2,000 %, fällig 20.08.2051	120	0,01
346	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, fällig 20.04.2052	304	0,02	769	Ginnie Mae II Pool 'MA7595', 5,500 %, fällig 20.08.2051	791	0,06
242	Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, fällig 20.09.2052	235	0,02	6.445	Ginnie Mae II Pool 'MA7648', 2,000 %, fällig 20.10.2051	5.300	0,43
7.615	Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500 %, fällig 20.08.2052	7.369	0,60	2.893	Ginnie Mae II Pool 'MA7990', 4,000 %, fällig 20.04.2052	2.733	0,22
584	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	562	0,05	3.997	Ginnie Mae II Pool 'MA8044', 3,500 %, fällig 20.05.2052	3.680	0,30
898	Ginnie Mae II Pool '786795', 6,000 %, fällig 20.07.2053	922	0,08	989	Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000 %, fällig 20.06.2052	934	0,08
1.255	Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, fällig 20.08.2053	1.269	0,10	99	Ginnie Mae II Pool 'MA8263', 2,000 %, fällig 20.09.2052	82	0,01
231	Ginnie Mae II Pool '786928', 6,500 %, fällig 20.09.2053	239	0,02	7.030	Ginnie Mae II Pool 'MA8269', 5,000 %, fällig 20.09.2052	6.961	0,57
1.589	Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, fällig 20.09.2053	1.637	0,13	3.131	Ginnie Mae II Pool 'MA8347', 4,500 %, fällig 20.10.2052	3.026	0,25
1.960	Ginnie Mae II Pool '786973', 6,000 %, fällig 20.09.2053	2.012	0,16	482	Ginnie Mae II Pool 'MA8422', 2,000 %, fällig 20.11.2052	396	0,03
1.487	Ginnie Mae II Pool '787058', 5,000 %, fällig 20.08.2053	1.479	0,12	3.058	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, fällig 20.11.2052	3.072	0,25
153	Ginnie Mae II Pool '787154', 6,500 %, fällig 20.11.2053	158	0,01	2.212	Ginnie Mae II Pool 'MA8484', 2,000 %, fällig 20.12.2052	1.819	0,15
784	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	808	0,07	1.926	Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000 %, fällig 20.03.2053	1.584	0,13
2.272	Ginnie Mae II Pool '787236', 6,500 %, fällig 20.01.2054	2.341	0,19	89	Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000 %, fällig 20.04.2053	84	0,01
5.951	Ginnie Mae II Pool '787298', 5,000 %, fällig 20.01.2050	5.936	0,49	6.304	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig 20.04.2053	6.343	0,52
192	Ginnie Mae II Pool '892346', 7,328 %, fällig 20.08.2059 *	199	0,02	882	Ginnie Mae II Pool 'MA9011', 2,500 %, fällig 20.07.2053	758	0,06
63	Ginnie Mae II Pool '892614', 6,942 %, fällig 20.08.2060 *	65	0,01	14.800	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	14.617	1,20
702	Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500 %, fällig 20.08.2046	653	0,05	19.500	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	19.551	1,60
924	Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500 %, fällig 20.08.2046	858	0,07	11.100	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	11.252	0,92
947	Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500 %, fällig 20.08.2046	878	0,07	6.000	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,500 % ±	6.122	0,50
349	Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, fällig 20.02.2047	330	0,03	458	Government National Mortgage Association, Series 2004 81, Class SK, 1,774 %, fällig 16.10.2034 *	17	–
404	Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, fällig 20.08.2047	375	0,03	850	Government National Mortgage Association, Series 2008 40, Class SC, 1,924 %, fällig 16.05.2038 *	62	0,01
2.579	Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, fällig 20.10.2047	2.398	0,20	1.101	Government National Mortgage Association, Series 2008 79, Class ID, 2,374 %, fällig 20.06.2035 *	52	–
242	Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, fällig 20.10.2047	225	0,02	80	Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Class FA, 5,110 %, fällig 20.02.2060 *	80	0,01
1.256	Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, fällig 20.10.2047	1.164	0,10	224	Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 4,770 %, fällig 20.10.2060 *	223	0,02
28	Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, fällig 20.06.2048	27	–	115	Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 4,790 %, fällig 20.05.2059 *	114	0,01
425	Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, fällig 20.07.2048	410	0,03	139	Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Class FE, 4,840 %, fällig 20.12.2060 *	139	0,01
860	Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, fällig 20.08.2048	840	0,07	526	Government National Mortgage Association, Series 2011 146, Class KS, 1,674 %, fällig 16.11.2041 *	49	–
573	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	526	0,04	719	Government National Mortgage Association, Series 2011 79, Class KS, 0,974 %, fällig 20.05.2041 *	55	–
105	Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20.10.2049	100	0,01	20.408	Government National Mortgage Association, Series 2013 72, Class IO, 0,569 %, fällig 16.11.2047 *	391	0,03
402	Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig 20.01.2050	375	0,03	7.873	Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Class SA, 1,774 %, fällig 16.06.2043 *	883	0,07
348	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	332	0,03	6.117	Government National Mortgage Association, Series 2014 118, Class ZD, 2,500 %, fällig 16.08.2044	5.292	0,43
64	Ginnie Mae II Pool 'BS5846', 2,500 %, fällig 20.12.2050	54	–	708	Government National Mortgage Association, Serie 2014 2, Klasse CI, 4,500 %, fällig 20.01.2044	166	0,01
425	Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig 20.12.2050	361	0,03	1.974	Government National Mortgage Association, Series 2014 60, Class SA, 1,674 %, fällig 16.04.2044 *	232	0,02
824	Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, fällig 20.05.2050	777	0,06				
1.956	Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, fällig 20.05.2050	1.845	0,15				
615	Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, fällig 20.07.2050	591	0,05				
828	Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000 %, fällig 20.08.2050	784	0,06				
1.238	Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, fällig 20.10.2050	1.088	0,09				
79	Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000 %, fällig 20.06.2052	74	0,01				
71	Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, fällig 20.04.2052	63	0,01				
435	Ginnie Mae II Pool 'CW6992', 6,000 %, fällig 20.09.2053	445	0,04				
132	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	123	0,01				
72	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	67	0,01				
124	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	115	0,01				

[^] 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 28. Februar 2025 – (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)				14.968	Government National Mortgage Association, Series 2021 191, Class NI, 3,000 %, fällig 20.10.2051	2.889	0,24		
7.262	Government National Mortgage Association, Series 2015 136, Class IO, 0,367 %, fällig 16.08.2055 *	97	0,01	2.702	Government National Mortgage Association, Serie 2021 21, Klasse AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	1.984	0,16		
3.074	Government National Mortgage Association, Serie 2015 177, Klasse MI, 5,000 %, fällig 20.10.2044	611	0,05	6.759	Government National Mortgage Association, Serie 2021 216, Klasse NI, 3,000 %, fällig 20.12.2051	1.282	0,11		
2.160	Government National Mortgage Association, Series 2015 20, Class PI, 3,500 %, fällig 20.02.2045	344	0,03	1.773	Government National Mortgage Association, Series 2021 26, Class AI, 2,000 %, fällig 20.02.2051	232	0,02		
1.634	Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class DY, 3,000 %, fällig 20.03.2045	1.461	0,12	808	Government National Mortgage Association, Serie 2021 29, Klasse AG, 5,000 %, fällig 20.02.2051	802	0,07		
25.837	Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,526 %, fällig 16.02.2059 *	789	0,06	47.226	Government National Mortgage Association, Series 2021 37, Class IO, 0,799 %, fällig 16.01.2061 *	2.770	0,23		
1.531	Government National Mortgage Association, Series 2017 19, Class SE, 1,724 %, fällig 16.02.2047 *	163	0,01	6.113	Government National Mortgage Association, Serie 2021 46, Klasse NI, 2,500 %, fällig 20.03.2051	1.024	0,08		
3.083	Government National Mortgage Association, Serie 2017 26, Klasse IQ, 5,000 %, fällig 20.02.2040	601	0,05	20.446	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	1.620	0,13		
6.674	Government National Mortgage Association, Series 2017 8, Class IO, 0,445 %, fällig 16.08.2058 *	133	0,01	28.572	Government National Mortgage Association, Series 2021 60, Class IO, 0,826 %, fällig 16.05.2063 *	1.763	0,14		
329	Government National Mortgage Association, Series 2017 H22, Class JF, 4,583 %, fällig 20.10.2067 *	328	0,03	4.846	Government National Mortgage Association, Serie 2021 7, Klasse TI, 2,500 %, fällig 16.01.2051	846	0,07		
1.532	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 1,824 %, fällig 20.09.2048 *	181	0,01	29.257	Government National Mortgage Association, Series 2021 70, Class IO, 0,705 %, fällig 16.04.2063 *	1.574	0,13		
2.309	Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Class SM, 1,774 %, fällig 20.10.2048 *	248	0,02	537	Government National Mortgage Association, Serie 2021 8, Klasse AQ, 5,000 %, fällig 20.01.2051	532	0,04		
671	Government National Mortgage Association, Serie 2018 168, Klasse PA, 4,000 %, fällig 20.08.2048	637	0,05	3.292	Government National Mortgage Association, Series 2021 9, Class MI, 2,500 %, fällig 20.01.2051	492	0,04		
560	Government National Mortgage Association, Serie 2018 37, Klasse QA, 2,750 %, fällig 20.03.2048	497	0,04	28.176	Government National Mortgage Association, Series 2021 97, Class TI, 3,000 %, fällig 20.08.2050	4.119	0,34		
500	Government National Mortgage Association, Serie 2019 128, Klasse AL, 2,500 %, fällig 20.10.2049	347	0,03	5.400	Government National Mortgage Association, Series 2022 102, Class CB, 2,250 %, fällig 16.06.2064 *	3.240	0,27		
500	Government National Mortgage Association, Serie 2019 18, Klasse TP, 3,500 %, fällig 20.02.2049	451	0,04	1.100	Government National Mortgage Association, Serie 2022 139, Klasse AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	1.001	0,08		
10.500	Government National Mortgage Association, Series 2019 85, Class LS, 0,000 %, fällig 20.07.2049 *	201	0,02	9.200	Government National Mortgage Association, Serie 2022 147, Klasse B, 2,200 %, fällig 16.10.2063	6.749	0,55		
40	Government National Mortgage Association, Series 2019 H01, Class FT, 4,840 %, fällig 20.10.2068 *	40	–	9.289	Government National Mortgage Association, Serie 2022 158, Klasse AL, 2,100 %, fällig 16.08.2064	6.582	0,54		
4.712	Government National Mortgage Association, Serie 2020 116, Klasse GI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	695	0,06	4.420	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	197	0,02		
1.621	Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Class IM, 2,500 %, fällig 20.08.2050	232	0,02	8.345	Government National Mortgage Association, Series 2022 5, Class LI, 3,500 %, fällig 20.01.2052	1.552	0,13		
3.224	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class EI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	459	0,04	1.461	Government National Mortgage Association, Series 2022 50, Class NI, 3,000 %, fällig 20.09.2048	232	0,02		
403	Government National Mortgage Association, Serie 2020 129, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	57	–	3.286	Government National Mortgage Association, Series 2022 54, Class Z, 2,000 %, fällig 16.10.2063 *	1.403	0,11		
141	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	20	–	37.892	Government National Mortgage Association, Series 2022 55, Class IO, 0,566 %, fällig 16.01.2063 *	1.701	0,14		
5.006	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class QI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	843	0,07	1.900	Government National Mortgage Association, Serie 2022 63, Klasse LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	1.592	0,13		
207	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	29	–	1.300	Government National Mortgage Association, Series 2022 86, Class C, 2,250 %, fällig 16.10.2063 *	639	0,05		
1.299	Government National Mortgage Association, Series 2020 17, Class EU, 2,500 %, fällig 20.10.2049	1.147	0,09	16.284	Government National Mortgage Association, Series 2023 179, Class IO, 0,610 %, fällig 16.09.2063 *	709	0,06		
3.885	Government National Mortgage Association, Serie 2020 181, Klasse WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	457	0,04	6.595	Government National Mortgage Association, Serie 2023 8, Klasse AZ, 3,750 %, fällig 16.01.2065	4.565	0,37		
1.354	Government National Mortgage Association, Series 2020 187, Class MI, 3,000 %, fällig 20.12.2050	251	0,02	6.572	Government National Mortgage Association, Serie 2023 92, Klasse AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	5.035	0,41		
3.693	Government National Mortgage Association, Series 2020 191, Class IX, 2,500 %, fällig 20.12.2050	626	0,05	5.969	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	325	0,03		
25.066	Government National Mortgage Association, Series 2020 29, Class JI, 0,932 %, fällig 16.01.2060 *	1.428	0,12	1.362	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 6,159 %, fällig 15.09.2031 *	1.051	0,09		
4.269	Government National Mortgage Association, Series 2020 36, Class GS, 1,674 %, fällig 20.03.2050 *	579	0,05	2.120	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Serie 2017 GS8, Klasse A4, 3,469 %, fällig 10.11.2050	2.050	0,17		
19.352	Government National Mortgage Association, Series 2020 38, Class IO, 0,819 %, fällig 16.04.2062 *	1.152	0,09	790	HGI CRE CLO 2021-FL2 Ltd, Series 2021 FL2, Class A, 144A, 5,426 %, fällig 17.09.2036 *	788	0,06		
434	Government National Mortgage Association, Serie 2020 47, Klasse MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	84	0,01	1.885	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust 2018-C8, Serie 2018 C8, Klasse A4, 4,211 %, fällig 15.06.2051	1.839	0,15		
1.211	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	227	0,02	429	MF1 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6, Class A, 144A, 5,528 %, fällig 16.07.2036 *	430	0,04		
786	Government National Mortgage Association, Serie 2020 61, Klasse CI, 4,000 %, fällig 20.03.2050	147	0,01	1.608	MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class A, 144A, 5,508 %, fällig 16.10.2036 *	1.607	0,13		
735	Government National Mortgage Association, Series 2020 85, Class CI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	136	0,01	2.960	MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class A, 144A, 7,790 %, fällig 18.02.2040 *	2.964	0,24		
27.579	Government National Mortgage Association, Series 2021 110, Class IO, 0,874 %, fällig 16.11.2063 *	1.843	0,15	844	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	823	0,07		
667	Government National Mortgage Association, Series 2021 119, Class HC, 1,000 %, fällig 20.07.2051	510	0,04	1.197	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class A1, 144A, 1,156 %, fällig 27.11.2056 *	1.044	0,09		
7.651	Government National Mortgage Association, Series 2021 121, Class CI, 3,000 %, fällig 20.07.2051	1.361	0,11	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.243.820 \$)			1.200.674	98,39	
2.333	Government National Mortgage Association, Series 2021 135, Class A, 2,000 %, fällig 20.08.2051	1.889	0,15	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,17 %)					
8.868	Government National Mortgage Association, Series 2021 139, Class IE, 3,500 %, fällig 20.08.2051	1.713	0,14	USA – 0,16 % (29. Februar 2024: 0,17 %)					
1.194	Government National Mortgage Association, Series 2021 14, Class AB, 1,340 %, fällig 16.06.2063	866	0,07	2.000 PG&E Wildfire Recovery Funding LLC, Serie A-4, 5,212 %, fällig 01.12.2047				1.952	0,16
6.194	Government National Mortgage Association, Serie 2021 156, Klasse IE, 2,500 %, fällig 20.09.2051	1.009	0,08	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.035 \$)			1.952	0,16	
11.711	Government National Mortgage Association, Series 2021 158, Class IN, 2,500 %, fällig 20.09.2051	1.716	0,14						
3.395	Government National Mortgage Association, Series 2021 180, Class IO, 0,914 %, fällig 16.11.2063 *	234	0,02						

[^] 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 28. Februar 2025 – (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 – 2,12 % (29. Februar 2024: 1,03 %)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
USA – 2,12 % (29. Februar 2024: 1,03 %)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
17.210	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.05.2025	17.064	1,40	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
4.680	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.11.2025	4.702	0,38	Gesamtnettovermögen		
4.320	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	4.158	0,34			
		25.924	2,12			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 26.054 \$)						
				– 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 %.		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,38 % (29. Februar 2024: 1,52 %)				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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.677.000 \$ und machten 2,59 % des Nettovermögens aus.		
77.894	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	77.894	6,38	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 77.894 \$)				± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.367.420 \$)				ABKÜRZUNGEN:		
Futures – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,03 %)				REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.668	0,14	TBA – wird noch bekannt gegeben.		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				Verteilung des Gesamtvermögens		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – -1,72 % (29. Februar 2024: 0,55 %)				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
-500	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	-400	-0,03	Organismen für gemeinsame Anlagen		
-18.800	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	-15.716	-1,29	Derivative Finanzinstrumente		
-5.100	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	-4.916	-0,40	Sonstige Vermögenswerte		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten -20.496 \$)				Gesamtvermögen		
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert leerverkauften Anlagen (Anschaffungskosten -20.496 \$)						

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	735	\$ 81.654	\$ 921
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	141	16.109	316
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	339	36.591	292
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Bank of America Merrill Lynch	48	5.668	139
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 313 \$)				\$ 1.668
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -247 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 66 \$)				\$ 1.668

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,14 % (29. Februar 2024: 0,32 %)			Supranational – 1,27 % (29. Februar 2024: 1,34 %)		
27 Soundview Home Loan Trust 2006-2, Series 2006 2, Class M2, 4,959 %, fällig 25.03.2036 *	26	0,14	INR 20.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	233	1,27
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 26 \$)	26	0,14	Vereinigtes Königreich – 1,20 % (29. Februar 2024: 1,16 %)		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 16,48 % (29. Februar 2024: 19,49 %)			11 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	11	0,06
100 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class C, 3,982 %, fällig 15.09.2060 *	88	0,48	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	33	0,18
7.332 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Series 2018 B7, Class XA, 0,407 %, fällig 15.05.2053 *	86	0,47	200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	175	0,96
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 7,452 %, fällig 25.10.2041 *	103	0,56		219	1,20
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 7,102 %, fällig 25.12.2041 *	102	0,56	USA – 25,38 % (29. Februar 2024: 24,59 %)		
18 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	16	0,09	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	10	0,05
74 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01.03.2051	60	0,33	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,05
115 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 01.02.2050	101	0,55	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	19	0,11
72 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 01.10.2051	64	0,35	100 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	100	0,54
154 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 01.11.2051	136	0,74	10 AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	10	0,06
80 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, fällig 01.12.2051	67	0,37	80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	75	0,41
239 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 09.01.2048	228	1,25	10 AbbVie Inc, 4,950 %, fällig 15.03.2031	10	0,06
77 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 01.10.2051	64	0,35	10 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	10	0,06
75 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	67	0,37	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	17	0,09
79 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01.07.2051	64	0,35	10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,06
78 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	64	0,35	20 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	17	0,09
75 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 01.12.2051	64	0,35	20 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	12	0,06
157 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	145	0,79	32 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	32	0,17
66 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 01.10.2050	53	0,29	8 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	8	0,04
75 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 01.04.2051	60	0,33	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	20	0,11
63 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	54	0,29	30 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	30	0,17
72 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig 01.09.2051	61	0,33	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	35	0,19
62 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	51	0,28	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	31	0,17
16 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	13	0,07	20 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	21	0,11
318 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01.12.2049	291	1,59	50 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	46	0,25
78 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig 01.11.2051	66	0,36	10 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	9	0,05
115 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20.05.2050	109	0,60	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	17	0,09
192 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20.01.2051	171	0,93	10 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.07.2032	11	0,06
204 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	182	0,99	20 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	20	0,11
78 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig 20.02.2052	72	0,39	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	39	0,22
100 Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 % ±	99	0,54	20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	19	0,10
94 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	4	0,02	20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	13	0,07
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B2, 144A, 3,667 %, fällig 25.06.2057 *	213	1,16	13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	12	0,07
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 3.341 \$)	3.018	16,48	10 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	10	0,06
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 34,12 % (29. Februar 2024: 33,94 %)			20 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	20	0,11
Australien – 0,43 % (29. Februar 2024: 0,42 %)			30 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	30	0,17
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	19	0,10	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	229	1,25
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	20	0,11	10 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	10	0,05
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	40	0,22	10 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	10	0,05
	79	0,43	20 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	20	0,11
Belgien – 0,21 % (29. Februar 2024: 0,30 %)			10 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	11	0,06
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	38	0,21	10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	10	0,05
Brasilien – 0,88 % (29. Februar 2024: 1,45 %)			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	78	0,43
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	111	0,60	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	37	0,20
60 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	51	0,28	10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	8	0,04
	162	0,88	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	31	0,17
Kanada – 1,08 % (29. Februar 2024: 1,09 %)			10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	9	0,05
30 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 05.01.2025	30	0,16	30 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	30	0,16
20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 06.11.2025	20	0,11	150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	151	0,82
20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	20	0,11	200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	178	0,97
10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	10	0,05	10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	13	0,07
10 Rogers Communications Inc, 5,300 %, fällig 15.02.2034	10	0,05	50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	44	0,24
40 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 06.10.2025	40	0,22	50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	31	0,17
70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, fällig 06.12.2025	69	0,38	30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	31	0,17
	199	1,08	40 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	40	0,22
Kolumbien – 0,39 % (29. Februar 2024: 0,40 %)			10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	9	0,05
100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	72	0,39	60 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	59	0,32
Frankreich – 1,08 % (29. Februar 2024: 1,05 %)			30 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	24	0,13
200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	197	1,08	150 Delta Air Lines Inc, 3,735 %, fällig 15.01.2026	153	0,83
Israel – 0,63 % (29. Februar 2024: 0,61 %)			160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	159	0,87
120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 10.01.2026	116	0,63	40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	40	0,22
Macau – 1,06 % (29. Februar 2024: 1,02 %)			40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	35	0,19
200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	194	1,06	20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	19	0,10
Mexiko – 0,51 % (29. Februar 2024: 0,51 %)					
100 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	92	0,51			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	9	0,05	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	19	0,11
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	29	0,16	80 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	81	0,44
10 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	10	0,05	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	35	0,19
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	20	0,11	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	15	0,08
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	21	0,11	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	15	0,08
10 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Ewige Anleihe *	10	0,06	40 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	40	0,22
40 Enterprise Products Operating LLC, 5,550 %, fällig 16.02.2055	40	0,22	10 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,06
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	20	0,11	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	10	0,06
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	18	0,10	10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	10	0,05
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	151	0,82	20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	18	0,10
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,06	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,14
10 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	10	0,06	20 Warnermedia Holdings Inc, 5,391 %, fällig 15.03.2062	15	0,08
10 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	10	0,05	10 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	10	0,05
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	228	1,24	140 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	124	0,68
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	200	1,09	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01.03.2048	18	0,10
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	19	0,10		4.649	25,38
10 Georgia Power Co, 5,200 %, fällig 15.03.2035	10	0,06	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.979 \$)		
10 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2032	10	0,06		6.250	34,12
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	18	0,10	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 32,35 % (29. Februar 2024: 36,49 %)		
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	32	0,18	Brasilien – 1,35 % (29. Februar 2024: 1,47 %)		
10 Honeywell International Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2035	10	0,05	BRL 112 Brasilien, Letras do Tesouro Nacional, Series LTN, Nullkupon, fällig 01.01.2026	17	0,09
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	19	0,10	BRL 579 Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	77	0,42
10 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	10	0,06	200 Brasilien, Internationale Staatsanleihe, 5,000 %, fällig 27.01.2045	153	0,84
10 Intel Corp, 5,700 %, fällig 10.02.2053	9	0,05		247	1,35
20 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	21	0,11	Indonesien – 1,00 % (29. Februar 2024: 1,00 %)		
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	8	0,04	200 Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 4,625 %, fällig 15.04.2043	184	1,00
10 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	10	0,05	Mexiko – 0,80 % (29. Februar 2024: 7,98 %)		
10 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	9	0,05	200 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,350 %, fällig 15.01.2047	146	0,80
10 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	10	0,05	Peru – 0,17 % (29. Februar 2024: 0,18 %)		
10 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	10	0,06	30 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 6,550 %, fällig 14.03.2037	32	0,17
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	10	0,06	USA – 29,03 % (29. Februar 2024: 25,86 %)		
10 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	10	0,06	110 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β	111	0,61
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	26	0,14	70 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.11.2025	70	0,38
20 Meta Platforms Inc, 4,750 %, fällig 15.08.2034	20	0,11	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	10	0,05
55 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	55	0,30	50 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2029	50	0,28
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	40	0,22	10 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 30.11.2029	10	0,05
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	110	0,60	110 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	110	0,60
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	66	0,36	280 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	283	1,54
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	20	0,11	870 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	896	4,89
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	15	0,08	180 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	175	0,96
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	39	0,21	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	9	0,05
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	19	0,10	20 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.11.2034	20	0,11
10 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	10	0,06	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	157	0,86
20 ONEOK Inc, 5,650 %, fällig 01.11.2028	21	0,11	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	7	0,04
20 Oracle Corp, 3,600 %, fällig 01.04.2050	14	0,08	70 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	66	0,36
10 Philip Morris International Inc, 4,875 %, fällig 13.02.2029	10	0,06	20 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	18	0,10
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 05.01.2030	18	0,10	80 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	74	0,40
10 Philip Morris International Inc, 5,250 %, fällig 13.02.2034	10	0,06	60 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	62	0,34
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	18	0,10	110 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	84	0,46
10 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	10	0,05	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	37	0,20
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,812 %, fällig 12.06.2026 *	10	0,05	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	33	0,18
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,06	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	104	0,57
20 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	20	0,11	230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	127	0,70
10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	10	0,06	230 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	136	0,74
40 RTX Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	35	0,19	710 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	472	2,58
10 RTX Corp, 6,000 %, fällig 15.03.2031	11	0,06	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	30	0,17
10 RTX Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	9	0,05	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	217	1,18
20 Service Properties Trust, 8,375 %, fällig 15.06.2029	20	0,11	62 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	40	0,22
10 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	10	0,06	257 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	190	1,04
20 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	21	0,11	50 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	38	0,21
20 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	20	0,11	40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	37	0,20
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025 e	52	0,29	178 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	153	0,83
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 02.01.2031	10	0,05	490 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	420	2,29
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	10	0,05	260 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	244	1,33
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	9	0,05	600 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	624	3,41
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	10	0,05	60 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	58	0,31
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	62	0,34	10 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	10	0,06
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	9	0,05	140 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	135	0,73
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	19	0,10		5.317	29,03
10 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	10	0,05	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.039 \$)		
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	20	0,11		5.926	32,35
10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	10	0,06	Schuldscheindarlehen – 2,75 % (29. Februar 2024: 4,83 %)		
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	41	0,23	51 1011778 Bc ULC, 6,062 %, fällig 23.09.2030 *	51	0,28
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	30	0,16	58 Allied Universal Holdco LLC, 8,162 %, fällig 14.05.2028 *	58	0,32
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	10	0,05	19 Brown Group Holding LLC, 6,812 %, fällig 01.07.2031 *	19	0,10

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
47 Charter Communications Operating LLC, 6,310 %, fällig 09.12.2030 *	47	0,26	– U.S. 10 Year April 2025 Put 106,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
48 Citadel Securities LP, 6,329 %, fällig 24.10.2031 *	48	0,26	– U.S. 10 Year April 2025 Put 107,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
19 Gainwell Acquisition Corp, 8,429 %, fällig 01.10.2027 *	18	0,10	– U.S. 10 Year Juni 2025 Call 112,50, fällig 23.05.2025 – Morgan Stanley	-13	-0,07
45 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,462 %, fällig 15.11.2027 *	44	0,24	– U.S. 10 Year May 2025 Put 106,00, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	-1	-0,01
30 Harbor Freight Tools, 7,241 %, fällig 05.06.2031 *	30	0,16	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 110,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	-8	-0,04
25 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 6,562 %, fällig 05.05.2028 *	25	0,14	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 109,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
31 Nexstar Broadcasting Inc, 6,926 %, fällig 19.09.2026 *	31	0,17	– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,50, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	-2	-0,01
19 Quikrete Holdings, Inc., 6,562 %, fällig 26.03.2029 *	20	0,11	– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-2	-0,01
30 Sotera Health, 7,562 %, fällig 23.05.2031 *	30	0,16	– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-2	-0,01
23 Spirit Airlines, 11,322 %, fällig 18.11.2025 *	23	0,13	– U.S. 5 Year April 2025 Call 108,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-4	-0,02
60 Virgin Media Bristol LLC, 6,926 %, fällig 04.01.2028 *	59	0,32	– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 505 \$)	503	2,75	– U.S. 5 Year April 2025 Put 105,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
Organismen für gemeinsame Anlagen – 8,98 % (29. Februar 2024: 0,72 %)					
1.645 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.645	8,98	– U.S. Bond April 2025 Put 109,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.645 \$)	1.645	8,98	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -58 \$)	-67	-0,37
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 19.535 \$)	17.368	94,82	Index-Swaps – -0,23 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-43	-0,23
			Zinsswaps – -0,38 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-69	-0,38
			Devisenterminkontrakte – -0,21 % (29. Februar 2024: -0,34 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-39	-0,21
			Futures – -0,86 % (29. Februar 2024: -0,21 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-157	-0,86
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-375	-2,05
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	17.342	94,67
			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	975	5,33
			Gesamtnettovermögen	18.317 \$	100,00
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	– 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 %.		
Gekaufte Optionen – 0,57 % (29. Februar 2024: 0,18 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,0625, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	8	0,05	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.592.000 \$ und machten 8,72 % des Nettovermögens aus.	
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,25, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	11	0,06	*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.	
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,3125, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	18	0,10	ε	Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2025 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).	
– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,00, fällig 13.06.2025 – Morgan Stanley	4	0,02	±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.	
– CME 3 Month SOFR Futures September 2025 Call 96,1250, fällig 12.09.2025 – Morgan Stanley	8	0,04	β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.	
– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	4	0,02	ABKÜRZUNGEN:		
– U.S. 10 Year April 2025 Call 110,25, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	15	0,08	Ewige Anleihe	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.	
– U.S. 10 Year April 2025 Put 108,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	–	–	TBA	– To be announced.	
– U.S. 10 Year May 2025 Put 107,50, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	1	0,01	BRL	– Brasilianischer Real	
– U.S. 10 Year W1 März 2025 Call 111,00, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	10	0,05	INR	– Indische Rupie	
– U.S. 10 Year W1 März 2025 Put 110,00, fällig 07.03.2025 – Morgan Stanley	1	0,01	Verteilung des Gesamtvermögens		
– U.S. 5 Year April 2025 Call 107,50, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	4	0,02	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
– U.S. 5 Year May 2025 Call 106,50, fällig 25.04.2025 – Morgan Stanley	20	0,11	Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 69 \$)	104	0,57	Organismen für gemeinsame Anlagen		
Credit Default Swaps – 0,74 % (29. Februar 2024: 0,56 %)			Derivative Finanzinstrumente		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	136	0,74	Sonstige Vermögenswerte		
Devisenterminkontrakte – 0,19 % (29. Februar 2024: 0,11 %)			Gesamtvermögen		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	36	0,19	100,00		
Futures – 0,40 % (29. Februar 2024: 0,40 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	73	0,40			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	17.717	96,72			
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Verkaufte Optionen – -0,37 % (29. Februar 2024: -0,10 %)					
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,5625, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	-9	-0,05			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Call 96,75, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	-7	-0,04			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2025 Put 95,3750, fällig 12.12.2025 – Morgan Stanley	-1	-0,01			
– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2025 Call 96,50, fällig 13.06.2025 – Morgan Stanley	-3	-0,02			
– U.S. 10 Year April 2025 Call 109,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-7	-0,04			
– U.S. 10 Year April 2025 Call 111,00, fällig 21.03.2025 – Morgan Stanley	-8	-0,04			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	645	\$ 48
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2029	4.054	88
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 103 \$)				\$ 136
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 103 \$)				\$ 136

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	3.440	\$ -69
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -4 \$)				-69
Nettowertminderung aus Zinsswaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -4 \$)				\$ -69

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 4,060 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR Compound	30. Nov. 2031	2.305	\$ -43
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 387 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				-43
Nettowertminderung aus Index-Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): 387 \$)				\$ -43

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2025	Citi	Kauf	USD 621	Verkauf	BRL 3.568	\$ 15
6. März 2025	Citi	Kauf	BRL 3.568	Verkauf	USD 601	4
02. Apr. 2025	Citi	Kauf	BRL 3.568	Verkauf	USD 617	-16
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 19	Verkauf	GBP 15	-1
16. Apr. 2025	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	AUD 51	Verkauf	USD 32	–
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	USD 349	Verkauf	GBP 284	-7
16. Apr. 2025	BNP Paribas	Kauf	CAD 191	Verkauf	USD 133	-1
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 346	Verkauf	CHF 313	-2
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	NOK 1.734	Verkauf	USD 152	2
16. Apr. 2025	Citi	Kauf	JPY 47.349	Verkauf	USD 302	14
16. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 822	Verkauf	CNH 6.032	-7
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 219	Verkauf	EUR 211	-1
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 496	Verkauf	MXN 10.238	1
16. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	MXN 21.372	Verkauf	USD 1.037	-4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 20 \$)						\$ 36
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -62 \$)						-39
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -42 \$)						\$ -3

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	27	\$ 6.501	\$ 10
3 Month SOFR Index Dezember 2026	Morgan Stanley	17	4.099	11
3 Month SOFR Index März 2025	Morgan Stanley	2	479	–
3 Month SOFR Index September 2025	Morgan Stanley	-4	-962	-2
Australian Dollar Currency März 2025	Morgan Stanley	3	186	-6
Long Gilt Juni 2025	Morgan Stanley	4	470	4
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	24	2.666	33
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Morgan Stanley	-10	-1.142	-27
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	-24	-4.967	-23
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	28	3.022	12
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	4	472	3
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2025	Morgan Stanley	-31	-3.848	-99
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 74 \$)				\$ 73
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -39 \$)				-157
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 35 \$)				\$ -84

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

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 – 96,80 % (29. Februar 2024: 85,07 %)				Devisenterminkontrakte – 0,84 % (29. Februar 2024: 0,59 %)		
Australien – 2,59 % (29. Februar 2024: 4,00 %)				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
AUD	1.320	Australische Staatsanleihe, Serie 142, 4,250 %, fällig 21.04.2026	823	1,34	515	0,84
AUD	1.230	Australische Staatsanleihe, Serie 170, 4,250 %, fällig 21.06.2034	763	1,25	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	
			1.586	2,59	61.077	99,87
Kolumbien – 0,19 % (29. Februar 2024: 4,45 %)				Devisenterminkontrakte – -0,25 % (29. Februar 2024: -1,62 %)		
COP	590.000	Kolumbien, TES, Series B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	114	0,19	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	
Mexiko – 5,72 % (29. Februar 2024: 9,02 %)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
MXN	24.600	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	980	1,60	-154	-0,25
MXN	17.600	Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	706	1,16	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	
MXN	45.700	Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	1.810	2,96	60.923	99,62
			3496	5,72	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	
Vereinigtes Königreich – 23,40 % (29. Februar 2024: 6,64 %)				Gesamtneutrovermögen		
GBP	5.180	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 31.07.2034	6.410	10,48	61.154 \$	100,00
GBP	5.190	United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	2.974	4,87	– 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 %.	
GBP	4.380	United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	4.925	8,05		
			14.309	23,40	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.	
USA – 64,90 % (29. Februar 2024: 39,84 %)				ABKÜRZUNGEN:		
	5500	United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025 *	5.502	9,00	AUD	– Australischer Dollar
	9.500	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025 *	9.512	15,55	COP	– Kolumbianischer Peso
	8.240	United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026 *	8.252	13,49	GBP	– Britisches Pfund Sterling
	11.100	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026 *	11.125	18,19	MXN	– Mexikanischer Peso
	3.350	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	3.466	5,67	Verteilung des Gesamtvermögens	
	1.910	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	1.833	3,00	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	
			39.690	64,90	Organismen für gemeinsame Anlagen	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 61.053 \$)				59.195	96,80	91,03
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,23 % (29. Februar 2024: 1,79 %)						2,10
	1.367	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.367	2,23	Derivative Finanzinstrumente	
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.367 \$)				1.367	2,23	0,79
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 62.420 \$)				60.562	99,03	6,08

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf USD 803	Verkauf AUD 1.270	\$ 15
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf AUD 1.270	Verkauf USD 794	-6
12. März 2025	HSBC	Kauf USD 15.275	Verkauf GBP 11.990	193
12. März 2025	Standard Chartered Bank	Kauf USD 1.499	Verkauf GBP 1.210	-23
12. März 2025	Standard Chartered Bank	Kauf GBP 1.660	Verkauf USD 2.073	16
13. März 2025	Citi	Kauf USD 469	Verkauf JPY 73.000	-16
13. März 2025	Citi	Kauf JPY 44.000	Verkauf USD 285	7
13. März 2025	Citi	Kauf JPY 92.000	Verkauf USD 621	-10
13. März 2025	JP Morgan	Kauf USD 617	Verkauf JPY 95.000	-15
13. März 2025	JP Morgan	Kauf JPY 92.000	Verkauf USD 622	-10
14. März 2025	BNY	Kauf USD 84	Verkauf EUR 82	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 167	Verkauf EUR 159	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 134	Verkauf GBP 106	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 36	Verkauf GBP 29	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 20	Verkauf USD 24	–
14. März 2025	BNY	Kauf AUD 612	Verkauf USD 385	-5
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 9.213	Verkauf USD 11.416	176
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 13.783	Verkauf USD 14.240	67
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 3	Verkauf USD 3	–
15. Apr. 2025	HSBC	Kauf CLP 330.000	Verkauf USD 329	15
28. Apr. 2025	Citi	Kauf CAD 380	Verkauf USD 266	-3
28. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf CAD 1.750	Verkauf USD 1.225	-12
28. Apr. 2025	Standard Chartered Bank	Kauf USD 77	Verkauf CAD 110	1
29. Apr. 2025	Citi	Kauf USD 97	Verkauf MXN 2.000	–
29. Apr. 2025	Citi	Kauf USD 697	Verkauf MXN 14.500	-2
30. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf USD 111	Verkauf COP 480.000	-4
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf USD 1.431	Verkauf EUR 1.370	5

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	EUR	1.000	Verkauf	USD	1.043	\$	-2
05. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	EUR	730	Verkauf	USD	770		-10
14. Mai 2025	Citi	Kauf	USD	332	Verkauf	KRW	480.000		2
14. Mai 2025	Citi	Kauf	KRW	480.000	Verkauf	USD	336		-7
14. Mai 2025	HSBC	Kauf	CLP	110.000	Verkauf	USD	114		–
14. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	NZD	2.130	Verkauf	USD	1.223		-29
27. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	USD	1.563	Verkauf	CNH	11.260		12
06. Juni 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD	795	Verkauf	AUD	1.270		6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 855 \$)								\$	515
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -2.346 \$)									-154
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -1.491 \$)								\$	361

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 31,08 % (29. Februar 2024: 23,66 %)			USA – 9,65 % (29. Februar 2024: 38,17 %)		
1.330 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R03, Series 2023 R03, Class 2M2, 144A, 8,252 %, fällig 25.04.2043 *	1.426	1,06	1.040 United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025 *	1.041	0,77
1.780 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA2, Series 2023 DNA2, Class M1B, 144A, 7,603 %, fällig 25.04.2043 *	1.877	1,40	1.750 United States Treasury Floating Rate Note, 4,485 %, fällig 31.01.2026 *	1.754	1,31
3.976 Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	4.050	3,02	10.130 United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026 *	10.145	7,57
959 Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig 20.11.2053	977	0,73		12.940	9,65
2.082 Ginnie Mae II Pool 'MA9363', 6,000 %, fällig 20.12.2053	2.119	1,58			
702 Ginnie Mae II Pool 'MA9606', 6,000 %, fällig 20.04.2054	713	0,53			
1.157 Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	1.176	0,88			
2.316 Ginnie Mae II Pool 'MA9726', 6,000 %, fällig 20.06.2054	2.350	1,75			
4.282 Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	4.344	3,24			
5.606 Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	5.688	4,25			
4.187 Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	4.248	3,17			
2.580 Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	2.620	1,96			
4.699 Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	4.770	3,56			
608 Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	617	0,46			
4.610 Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	4.680	3,49			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 41.423 \$)	41.655	31,08	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 63.910 \$)	58.136	43,37
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 20,24 % (29. Februar 2024: 7,72 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,06 % (29. Februar 2024: 5,53 %)		
Australien – 2,12 % (29. Februar 2024: 2,21 %)			4.102 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4.102	3,06
2.840 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,128 %, fällig 14.03.2025 *	2.841	2,12			
Kanada – 1,97 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.102 \$)	4.102	3,06
2.630 Toronto-Dominion Bank/The, 4,568 %, fällig 17.12.2026	2.634	1,97			
Mexiko – 2,30 % (29. Februar 2024: 1,01 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 136.495 \$)	131.020	97,75
1.340 Petroleos Mexicanos, 6,500 %, fällig 13.03.2027	1.316	0,98	Devisenterminkontrakte – 1,14 % (29. Februar 2024: 2,08 %)		
2.110 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	1.456	1,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.531	1,14
300 Trust Fibra Uno, 144A, 7,700 %, fällig 23.01.2032	311	0,23	Futures – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,17 %)		
	3.083	2,30	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	104	0,08
USA – 13,85 % (29. Februar 2024: 4,50 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	132.655	98,97
865 Aircastle Ltd, 144A, 5,250 %, Ewige Anleihe *	853	0,64	Devisenterminkontrakte – -1,50 % (29. Februar 2024: -2,69 %)		
1.400 Ally Financial Inc, Series B, 4,700 %, Ewige Anleihe *	1.360	1,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.008	-1,50
1.390 American Express Co, 3,550 %, Ewige Anleihe *	1.350	1,01	Futures – -0,18 % (29. Februar 2024: -0,03 %)		
1.660 Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, fällig 16.09.2027	1.744	1,30	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-234	-0,18
735 BP Capital Markets Plc, 4,375 %, Ewige Anleihe *	733	0,55	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-2.242	-1,68
610 Charles Schwab Corp/The, Series G, 5,375 %, Ewige Anleihe *	612	0,45	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	130.413	97,29
2.884 Citigroup Inc, Series X, 3,875 %, Ewige Anleihe *	2.823	2,10	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	3.619	2,71
2.700 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	2.717	2,03	Gesamtnettovermögen	134.032 \$	100,00
1.015 Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	910	0,68			
1.061 NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	1.049	0,78			
670 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	619	0,46			
2.590 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	2.596	1,94			
1.226 Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	1.203	0,90			
	18.569	13,85			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.060 \$)	27.127	20,24			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 43,37 % (29. Februar 2024: 63,28 %)					
Brasilien – 8,57 % (29. Februar 2024: 3,61 %)					
BRL 56.290 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	7.443	5,55			
BRL 31.710 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2035	4.040	3,02			
	11.483	8,57			
Kolumbien – 3,91 % (29. Februar 2024: 6,98 %)					
COP 2.780.000 Kolumbien, TES, Series B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	536	0,40			
COP 31.810.000 Kolumbien, TES, Series B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	4.708	3,51			
	5.244	3,91			
Ägypten – 6,88 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
EGP 241.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.04.2025	4.667	3,48			
EGP 251.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.07.2025	4.548	3,40			
	9.215	6,88			
Mexiko – 7,09 % (29. Februar 2024: 6,01 %)					
MXN 240.000 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	9.506	7,09			
Polen – 3,05 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
PLN 17.660 Republik Polen, Staatsanleihe, Series CPI, 2,000 %, fällig 25.08.2036 β	4.089	3,05			
Südafrika – 4,22 % (29. Februar 2024: 3,55 %)					
ZAR 134.100 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	5.659	4,22			

– 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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.976.000 \$ und machten 6,69 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

ABKÜRZUNGEN:

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

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

BRL – Brasilianischer Real

COP – Kolumbianischer Peso

EGP – Ägyptisches Pfund

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	92,55
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,99
Derivative Finanzinstrumente	1,19
Sonstige Vermögenswerte	3,27
Gesamtvermögen	100,00

[^] 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 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
6. März 2025	Barclays	Kauf	AUD 10.670	Verkauf	USD 6.723	\$ -102	
6. März 2025	Citi	Kauf	USD 3.816	Verkauf	AUD 6.210	-38	
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 6.744	Verkauf	AUD 10.670	123	
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	AUD 6.210	Verkauf	USD 4.016	-163	
12. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	CHF 3.800	Verkauf	USD 4.170	44	
12. März 2025	UBS	Kauf	USD 11.317	Verkauf	CHF 9.820	428	
13. März 2025	Barclays	Kauf	USD 6.660	Verkauf	JPY 1.013.000	-78	
13. März 2025	Citi	Kauf	USD 5.459	Verkauf	JPY 849.000	-188	
13. März 2025	Citi	Kauf	JPY 1.129.000	Verkauf	USD 7.626	-117	
13. März 2025	Citi	Kauf	JPY 1.044.000	Verkauf	USD 6.732	212	
13. März 2025	HSBC	Kauf	USD 14.416	Verkauf	JPY 2.216.000	-324	
13. März 2025	HSBC	Kauf	JPY 805.000	Verkauf	USD 5.236	119	
13. März 2025	JP Morgan	Kauf	JPY 1.130.000	Verkauf	USD 7.636	-120	
13. März 2025	Standard Chartered Bank	Kauf	USD 197	Verkauf	JPY 30.000	-2	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD –	Verkauf	GBP –	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 2.474	Verkauf	USD 2.557	11	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 2.207	Verkauf	USD 2.734	42	
14. Apr. 2025	HSBC	Kauf	NZD 11.900	Verkauf	USD 6.734	-69	
14. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	NZD 11.690	Verkauf	USD 6.708	-160	
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf	USD 5.175	Verkauf	BRL 31.740	-164	
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf	USD 9.273	Verkauf	BRL 53.760	227	
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf	BRL 15.750	Verkauf	USD 2.612	38	
28. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 6.676	Verkauf	CAD 9.600	23	
28. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	CAD 19.230	Verkauf	USD 13.435	-108	
29. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 1.801	Verkauf	MXN 37.100	11	
29. Apr. 2025	Citi	Kauf	MXN 114.600	Verkauf	USD 5.511	18	
30. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 4.023	Verkauf	PLN 16.490	-44	
30. Apr. 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD 6.727	Verkauf	HUF 2.600.000	55	
30. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 5.216	Verkauf	COP 22.520.000	-164	
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	EUR 25.590	Verkauf	USD 26.729	-91	
13. Mai 2025	HSBC	Kauf	USD 2.654	Verkauf	ZAR 49.000	51	
14. Mai 2025	HSBC	Kauf	CLP 6.410.000	Verkauf	USD 6.746	-76	
27. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	USD 17.550	Verkauf	CNH 126.460	129	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 3.036 \$)						\$ 1.531	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -3.927 \$)						-2.008	
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -891 \$)						\$ -477	

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Kanada, 10-jährige Anleihe, Juni 2025	Morgan Stanley	-524	\$ -45.191	\$ -234
Long Gilt Juni 2025	Morgan Stanley	254	29.852	104
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 256 \$)				\$ 104
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -51 \$)				-234
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 205 \$)				\$ -130

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

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 – 91,39 % (29. Februar 2024: 94,58 %)					
Australien – 2,28 % (29. Februar 2024: 0,51 %)					
450 Coronado Finance Pty Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2029	456	1,06	450 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	455	1,06
525 Mineral Resources Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 01.05.2027	525	1,22	250 Amentum Holdings Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.08.2032	255	0,59
	981	2,28	350 AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, fällig 15.10.2028	373	0,86
Österreich – 1,14 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
EUR 450 Benteler International AG, 9,375 %, fällig 15.05.2028	493	1,14	750 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	689	1,60
Brasilien – 1,72 % (29. Februar 2024: 1,77 %)					
300 CSN Resources SA, 4,625 %, fällig 10.06.2031	232	0,54	575 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	520	1,21
200 LD Celulose International GmbH, 144A, 7,950 %, fällig 26.01.2032	208	0,48	550 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.02.2032	559	1,30
300 Vale Overseas Ltd, 6,400 %, fällig 28.06.2054	302	0,70	635 Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, fällig 12.08.2025	636	1,48
	742	1,72	365 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	369	0,85
Kanada – 5,00 % (29. Februar 2024: 6,77 %)					
350 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2030	359	0,83	400 Cable One Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.11.2030	326	0,76
175 CI Financial Corp, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2029	184	0,43	100 California Resources Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2026	100	0,23
175 CI Financial Corp, 3,200 %, fällig 17.12.2030	153	0,35	475 Carnival Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.03.2026	476	1,10
250 goeasy Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.12.2028	267	0,62	600 CCM Merger Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.05.2026	602	1,40
636 Saturn Oil & Gas Inc, 144A, 9,625 %, fällig 15.06.2029	627	1,45	300 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	279	0,65
350 Strathcona Resources Ltd/Alberta, 144A, 6,875 %, fällig 01.08.2026	351	0,82	250 Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.06.2029	236	0,55
220 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	214	0,50	250 Century Communities Inc, 6,750 %, fällig 01.06.2027	250	0,58
	2.155	5,00	505 Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	481	1,12
Kolumbien – 0,81 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
350 Ecopetrol SA, 7,750 %, fällig 01.02.2032	347	0,81	505 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	473	1,10
Tschechische Republik – 1,30 % (29. Februar 2024: 1,90 %)					
535 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	560	1,30	500 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.09.2031	508	1,18
Dominikanische Republik – 0,47 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
200 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	204	0,47	150 Concentrix Corp, 6,850 %, fällig 02.08.2033	156	0,36
Frankreich – 0,90 % (29. Februar 2024: 2,14 %)					
200 Societe Generale SA, 144A, 3,625 %, fällig 01.03.2041	142	0,33	495 Credit Acceptance Corp, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2028	529	1,23
235 Societe Generale SA, 144A, 7,367 %, fällig 10.01.2053	247	0,57	350 Embecta Corp, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2030	335	0,78
	389	0,90	270 Encore Capital Group Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2028	321	0,75
Deutschland – 4,11 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
EUR 400 ASK Chemicals Deutschland Holding GmbH, 10,000 %, fällig 15.11.2029	429	0,99	350 Enova International Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2028	380	0,88
600 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	630	1,46	525 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	516	1,20
725 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	713	1,66	400 Fortrea Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.07.2030	402	0,93
	1.772	4,11	300 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	301	0,70
Israel – 0,45 % (29. Februar 2024: 5,20 %)					
200 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	192	0,45	350 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	350	0,81
Italien – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,34 %)					
EUR 100 Itelyum Regeneration Spa, 4,625 %, fällig 01.10.2026	104	0,24	130 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,000 %, fällig 15.01.2027	132	0,31
Japan – 1,15 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
500 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025	494	1,15	250 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 7,750 %, fällig 01.02.2028	253	0,59
Mexiko – 2,01 % (29. Februar 2024: 2,77 %)					
200 Fideicomiso Irrevocable de Administracion y Fuente de Pago Numero CIB/4323, 144A, 11,000 %, fällig 12.09.2030	209	0,49	300 Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026	300	0,70
199 FIEMEX Energia - Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple, 144A, 7,250 %, fällig 31.01.2041	200	0,46	400 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.07.2027	373	0,86
656 Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	455	1,06	270 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	239	0,55
	864	2,01	250 International Game Technology PLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2027	253	0,59
Puerto Rico – 0,59 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
300 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	256	0,59	375 Jefferson Capital Holdings LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2029	401	0,93
Trinidad und Tobago – 0,92 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
400 Port Of Spain Waterfront Development, 144A, 7,875 %, fällig 19.02.2040	397	0,92	123 Liberty Interactive LLC, 8,500 %, fällig 15.07.2029	61	0,14
Vereinigtes Königreich – 5,29 % (29. Februar 2024: 4,94 %)					
EUR 600 Ardonagh Finco Ltd, 6,875 %, fällig 15.02.2031	647	1,50	300 Lindblad Expeditions Holdings Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.05.2028	313	0,73
164 British Airways 2019-1 Klasse AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, fällig 15.12.2032	153	0,35	350 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2027	352	0,82
141 British Airways 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,250 %, fällig 15.11.2032	137	0,32	600 Live Nation Entertainment Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2026	600	1,39
600 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	551	1,28	350 Live Nation Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.05.2027	356	0,83
EUR 500 eG Global Finance Plc, 11,000 %, fällig 30.11.2028	584	1,36	350 Long Ridge Energy LLC, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2032	352	0,82
200 Howden UK Refinance Plc / Howden UK Refinance 2 Plc / Howden US Refinance LLC, 144A, 8,125 %, fällig 15.02.2032	205	0,48	575 Magnera Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.11.2029	523	1,21
	2.277	5,29	175 Manitowoc Co Inc/The, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2031	184	0,43
USA – 63,01 % (29. Februar 2024: 66,58 %)					
450 Adams Homes Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.10.2028	470	1,09	825 Mativ Holdings Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2029	765	1,78
910 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	750	1,74	400 Matthews International Corp, 144A, 8,625 %, fällig 01.10.2027	420	0,97
			300 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	287	0,67
			200 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	200	0,46
			400 NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 15.01.2029	425	0,98
			500 Owens & Minor Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.04.2030	461	1,07
			300 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	294	0,68
			500 PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	467	1,08
			600 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	573	1,33
			300 Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp, 144A, 9,750 %, fällig 15.09.2029	312	0,72
			900 QVC Inc, 5,450 %, fällig 15.08.2034	526	1,22
			95 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	91	0,21
			300 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 3,600 %, fällig 15.05.2025	298	0,69
			400 Ryan Specialty LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2032	398	0,92
			171 Sabre GBLB Inc, 10,750 %, fällig 15.11.2029	183	0,42
			144 Sabre GBLB Inc, 144A, 10,750 %, fällig 15.11.2029	154	0,36
			400 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	370	0,86
			150 SM Energy Co, 6,750 %, fällig 15.09.2026	150	0,35
			115 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	115	0,27
			200 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	204	0,47

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)					
400 Turning Point Brands Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.03.2032	414	0,96			
175 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	173	0,40			
250 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	243	0,56			
500 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	501	1,16			
300 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027	300	0,70			
450 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	455	1,06			
250 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	245	0,57			
399 Walgreens Boots Alliance Inc, 4,650 %, fällig 01.06.2046	278	0,65			
400 Wildfire Intermediate Holdings LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.10.2029	398	0,92			
207 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	207	0,48			
500 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	453	1,05			
	27.149	63,01			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 39.182 \$)	39.376	91,39			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,95 % (29. Februar 2024: 2,30 %)					
2.994 Western Asset Liquidity Funds Plc - Western Asset US Dollar Liquidity Fund - Klasse WA (ausschüttend)	2.994	6,95			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.994 \$)	2.994	6,95			
Stammaktien – 0,11 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
USA – 0,11 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
5 New Fortress Energy Inc 'A' ∞	47	0,11			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	47	0,11			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 42.176 \$)	42.417	98,45			
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,12 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	–			
Futures – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	23	0,05			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	42.441	98,50			
Devisenterminkontrakte – -0,54 % (29. Februar 2024: -0,23 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-232	-0,54			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-232	-0,54			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	42.209	97,96			
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	878	2,04			
Gesamtvermögen	43.087 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.491.000 \$ und machten 73,08 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.					
∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.					
ABKÜRZUNGEN:					
EUR – Euro					
GBP – Britisches Pfund Sterling					
Verteilung des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					90,75
Organismen für gemeinsame Anlagen					6,89
Derivative Finanzinstrumente					0,06
Sonstige Vermögenswerte					2,30
Gesamtvermögen					100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2025	BNY	Kauf CAD 3	Verkauf CHF 2	\$ –
12. März 2025	BNY	Kauf GBP –	Verkauf CHF –	–
12. März 2025	BNY	Kauf EUR 1	Verkauf CHF 1	–
12. März 2025	BNY	Kauf GBP 11	Verkauf EUR 13	–
12. März 2025	BNY	Kauf CAD 4.075	Verkauf EUR 2.744	-31
12. März 2025	BNY	Kauf EUR 147	Verkauf GBP 123	-2
12. März 2025	BNY	Kauf CAD 453	Verkauf GBP 255	-8
12. März 2025	BNY	Kauf GBP –	Verkauf SEK –	–
12. März 2025	BNY	Kauf EUR 1	Verkauf SEK 10	–
12. März 2025	BNY	Kauf CAD 3	Verkauf SEK 20	–
12. März 2025	BNY	Kauf GBP 57	Verkauf USD 71	1
12. März 2025	BNY	Kauf EUR 6.940	Verkauf USD 7.208	-5
12. März 2025	BNY	Kauf CAD 21.354	Verkauf USD 14.933	-166
12. März 2025	HSBC	Kauf GBP 340	Verkauf USD 433	-5
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf EUR 4.300	Verkauf USD 4.491	-15
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 38 \$)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -71 \$)				-232
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -33 \$)				\$ -231

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2025 Citi	40	\$ 4.444	\$ 23
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1 \$)			\$ 23
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1 \$)			\$ 23

[^] 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 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 13,89 % (29. Februar 2024: 13,23 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,10 % (29. Februar 2024: 1,73 %)		
2.978 Fannie Mae Pool 'MA5421', 6,000 %, fällig 01.07.2054	3.030	1,69	5.563 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.563	3,10
5.002 Fannie Mae Pool 'MA5445', 6,000 %, fällig 01.08.2054	5.089	2,84	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5.563 \$)	5.563	3,10
3.853 Freddie Mac Pool „SD8463“, 6,000 %, fällig 01.09.2054	3.919	2,18	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 189.878 \$)	179.233	99,85
4.521 Freddie Mac Pool „SD8470“, 6,000 %, fällig 01.10.2054	4.599	2,56	Devisenterminkontrakte – 0,67 % (29. Februar 2024: 0,45 %)		
454 Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	463	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.206	0,67
1.672 Ginnie Mae II Pool 'MA9363', 6,000 %, fällig 20.12.2053	1.702	0,95	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	180.439	100,52
165 Ginnie Mae II Pool 'MA9606', 6,000 %, fällig 20.04.2054	167	0,09	Devisenterminkontrakte – -1,06 % (29. Februar 2024: -1,85 %)		
241 Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	245	0,14	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.908	-1,06
341 Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	346	0,19	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.908	-1,06
4.731 Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	4.800	2,67	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	178.531	99,46
246 Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	250	0,14	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	974	0,54
99 Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	100	0,06	Gesamt Nettovermögen	179.505 \$	100,00
219 Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	222	0,12			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 24.584 \$)	24.932	13,89			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 3,20 % (29. Februar 2024: 0,95 %)			– 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 %.		
Kanada – 2,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.		
3.590 Toronto-Dominion Bank/The, 4,568 %, fällig 17.12.2026	3.596	2,00	ABKÜRZUNGEN:		
Mexiko – 1,20 % (29. Februar 2024: 0,95 %)			AUD	– Australischer Dollar	
3.110 Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	2.146	1,20	BRL	– Brasilianischer Real	
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.592 \$)	5.742	3,20	CAD	– Kanadischer Dollar	
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 79,66 % (29. Februar 2024: 84,27 %)			COP	– Kolumbianischer Peso	
Australien – 4,82 % (29. Februar 2024: 4,48 %)			EGP	– Ägyptisches Pfund	
AUD 13.890 Australische Staatsanleihe, Serie 142, 4,250 %, fällig 21.04.2026	8.660	4,82	EUR	– Euro	
Brasilien – 3,87 % (29. Februar 2024: 3,87 %)			GBP	– Britisches Pfund Sterling	
BRL 10.100 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.391	0,78	MXN	– Mexikanischer Peso	
BRL 12.820 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	1.695	0,94	ZAR	– Südafrikanischer Rand	
BRL 30.330 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2035	3.864	2,15			
	6.950	3,87			
Kanada – 2,91 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
CAD 7.600 Kanada, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 07.05.2025	5.226	2,91	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,14	
Kolumbien – 0,54 % (29. Februar 2024: 6,19 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen	3,05	
COP 2.170.000 Kolumbien, TES, Series B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	437	0,24	Derivative Finanzinstrumente	0,66	
COP 2.750.000 Kolumbien, TES, Series B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	530	0,30	Sonstige Vermögenswerte	1,15	
	967	0,54	Gesamtvermögen	100,00	
Ägypten – 4,66 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
EGP 219.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.04.2025	4.241	2,36			
EGP 228.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.07.2025	4.131	2,30			
	8.372	4,66			
Deutschland – 4,93 % (29. Februar 2024: 4,57 %)					
EUR 8.550 Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 16.04.2025	8.845	4,93			
Mexiko – 10,08 % (29. Februar 2024: 10,06 %)					
MXN 29.000 Mexiko, Bonos, Series M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.284	0,71			
MXN 101.400 Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	4.039	2,25			
MXN 72.900 Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	2.926	1,63			
MXN 248.700 Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	9.851	5,49			
	18.100	10,08			
Südafrika – 4,20 % (29. Februar 2024: 4,34 %)					
ZAR 178.500 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	7.532	4,20			
Vereinigtes Königreich – 16,86 % (29. Februar 2024: 10,11 %)					
GBP 28.190 United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	16.156	9,00			
GBP 12.540 United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	14.099	7,86			
	30.255	16,86			
USA – 26,79 % (29. Februar 2024: 35,49 %)					
13.620 United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025 *	13.637	7,60			
12.600 United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026 *	12.618	7,03			
16.490 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,501 %, fällig 31.10.2026 *	16.528	9,21			
5.530 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	5.306	2,95			
	48.089	26,79			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 154.139 \$)	142.996	79,66			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
6. März 2025	JP Morgan	Kauf	AUD 4.270	Verkauf	USD 2.643	\$ 6	
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 16.282	Verkauf	AUD 25.860		235
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf	AUD 21.590	Verkauf	USD 13.773		-376
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 257	Verkauf	AUD 233		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 422	Verkauf	CAD 343		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 2.445	Verkauf	CNY 9.960		-5
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 48	Verkauf	DKK 193		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 6.260	Verkauf	EUR 3.422		-48
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 1.083	Verkauf	GBP 495		-17
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 78	Verkauf	ILS 157		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 2.356	Verkauf	JPY 201.936		-25
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 165	Verkauf	MXN 1.931		-2
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 33	Verkauf	NOK 211		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 120	Verkauf	PLN 277		-1
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 35	Verkauf	SEK 219		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 81	Verkauf	SGD 61		–
12. März 2025	BNY	Kauf	NZD 10.060	Verkauf	USD 5.709		-79
12. März 2025	HSBC	Kauf	USD 23.976	Verkauf	GBP 18.820		303
13. März 2025	Citi	Kauf	USD 4.392	Verkauf	JPY 683.000		-151
13. März 2025	Citi	Kauf	JPY 532.000	Verkauf	USD 3.452		87
13. März 2025	Citi	Kauf	JPY 2.328.000	Verkauf	USD 15.726		-241
13. März 2025	JP Morgan	Kauf	USD 7.189	Verkauf	JPY 1.107.000		-175
13. März 2025	JP Morgan	Kauf	JPY 2.329.000	Verkauf	USD 15.738		-247
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 1	Verkauf	EUR 1		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 1	Verkauf	GBP 1		–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 32	Verkauf	USD 40		1
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 5	Verkauf	USD 5		–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR –	Verkauf	USD –		–
15. Apr. 2025	HSBC	Kauf	CLP 3.710.000	Verkauf	USD 3.695		167
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf	USD 7.079	Verkauf	BRL 41.020		178
28. Apr. 2025	Citi	Kauf	CAD 7.730	Verkauf	USD 5.413		-56
28. Apr. 2025	Morgan Stanley	Kauf	USD 5.471	Verkauf	CAD 7.730		113
29. Apr. 2025	Citi	Kauf	USD 2.141	Verkauf	MXN 44.100		14
29. Apr. 2025	Citi	Kauf	MXN 98.700	Verkauf	USD 4.746		15
30. Apr. 2025	JP Morgan	Kauf	USD 880	Verkauf	COP 3.800.000		-28
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf	EUR 35.810	Verkauf	USD 37.396		-120
05. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	EUR 8.540	Verkauf	USD 9.007		-117
13. Mai 2025	HSBC	Kauf	USD 3.590	Verkauf	ZAR 66.300		68
14. Mai 2025	Citi	Kauf	USD 3.521	Verkauf	KRW 5.100.000		18
14. Mai 2025	Citi	Kauf	KRW 5.100.000	Verkauf	USD 3.574		-71
14. Mai 2025	HSBC	Kauf	CLP 1.570.000	Verkauf	USD 1.633		1
14. Mai 2025	Morgan Stanley	Kauf	NZD 9.320	Verkauf	USD 5.352		-128
06. Juni 2025	Morgan Stanley	Kauf	AUD 4.380	Verkauf	USD 2.741		-21
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 942 \$)						\$	1.206
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -3.847 \$)							-1.908
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -2.905 \$)						\$	-702

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,40 %)					
4.590 Bellemeade Re 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M1B, 144A, 8,602 %, fällig 25.10.2033 *	4.791	0,52	3.620 Minerva Luxembourg SA, 144A, 8,875 %, fällig 13.09.2033	3.808	0,42
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.763 \$)	4.791	0,52	2.980 Raizen Fuels Finance SA, 144A, 5,700 %, fällig 17.01.2035	2.820	0,31
			790 Raizen Fuels Finance SA, 144A, 6,700 %, fällig 25.02.2037	791	0,09
			6.195 Yinson Boronia Production BV, 8,947 %, fällig 31.07.2042	6.611	0,72
				36.840	4,03
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 16,88 % (29. Februar 2024: 14,72 %)			Kanada – 4,73 % (29. Februar 2024: 4,36 %)		
161 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 7,866 %, fällig 25.10.2039 *	167	0,02	3.227 Air Canada 2015-1 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, fällig 15.03.2027	3.161	0,35
11.610 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 8,116 %, fällig 25.02.2040 *	12.157	1,33	5.598 Air Canada 2020-2 Klasse A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01.04.2029	5.658	0,62
12.085 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 2M2, 144A, 8,116 %, fällig 25.02.2040 *	12.655	1,38	6.090 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027	5.787	0,63
4.300 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02, Series 2023 R02, Class 1B1, 144A, 9,902 %, fällig 25.01.2043 *	4.761	0,52	5.364 Bank of Nova Scotia/The, 4,900 %, Ewige Anleihe *	5.355	0,59
410 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Series 2023 R07, Class 2B1, 144A, 8,853 %, fällig 25.09.2043 *	447	0,05	9.700 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2030	9.938	1,09
5.570 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Series 2023 R07, Class 2M2, 144A, 7,603 %, fällig 25.09.2043 *	5.867	0,64	6.385 Taseko Mines Ltd, 144A, 8,250 %, fällig 01.05.2030	6.634	0,72
437 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M1, 144A, 5,402 %, fällig 25.01.2044 *	438	0,05	6.890 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.717	0,73
3.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R05, Series 2024 R05, Class 2M2, 144A, 6,052 %, fällig 25.07.2044 *	3.523	0,38		43.250	4,73
7.602 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C02, Class 2M2C, 8,116 %, fällig 25.09.2029 *	7.877	0,86	Chile – 1,12 % (29. Februar 2024: 0,54 %)		
1.728 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 2M2, 7,266 %, fällig 25.02.2030 *	1.788	0,19	2.940 ATP Tower Holdings / Andean Telecom Partners Chile SpA / Andean Tower Partners C, 144A, 7,875 %, fällig 03.02.2030	2.953	0,32
5.930 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2021 R02, Class 2B1, 144A, 7,652 %, fällig 25.11.2041 *	6.129	0,67	2.720 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	2.676	0,29
5.855 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 8,352 %, fällig 25.11.2050 *	6.626	0,72	4.570 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	4.609	0,51
3.000 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Series 2021 HQA2, Class B1, 144A, 7,502 %, fällig 25.12.2033 *	3.377	0,37		10.238	1,12
2.420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M2, 144A, 8,102 %, fällig 25.02.2042 *	2.530	0,28	Kolumbien – 1,14 % (29. Februar 2024: 0,63 %)		
4.720 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 7,252 %, fällig 25.04.2042 *	4.903	0,54	3.540 Ecopetrol SA, 7,750 %, fällig 01.02.2032	3.512	0,39
5.105 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M2, 144A, 8,702 %, fällig 25.04.2042 *	5.427	0,59	3.230 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	3.386	0,37
2.780 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M1B, 144A, 7,702 %, fällig 25.05.2042 *	2.917	0,32	3.560 Geopark Ltd, 144A, 8,750 %, fällig 31.01.2030	3.491	0,38
12.635 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M2, 144A, 9,602 %, fällig 25.05.2042 *	13.685	1,50		10.389	1,14
7.420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M1B, 144A, 8,852 %, fällig 25.06.2042 *	7.986	0,87	Tschechische Republik – 0,55 % (29. Februar 2024: 0,44 %)		
13.690 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M2, 144A, 11,102 %, fällig 25.06.2042 *	15.340	1,68	4.850 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	5.077	0,55
10.155 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 10,102 %, fällig 25.09.2042 *	11.223	1,23	Dominikanische Republik – 0,25 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
2.870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA2, Series 2022 HQA2, Class M2, 144A, 10,352 %, fällig 25.07.2042 *	3.174	0,35	2.260 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	2.299	0,25
273 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA1, Series 2023 HQA1, Class M1A, 144A, 6,352 %, fällig 25.05.2043 *	276	0,03	Frankreich – 1,27 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
80 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA2, Series 2023 HQA2, Class M1A, 144A, 6,352 %, fällig 25.06.2043 *	80	0,01	3.420 Societe Generale SA, 144A, 7,367 %, fällig 10.01.2053	3.597	0,39
7.650 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA3, Series 2023 HQA3, Class M2, 144A, 7,702 %, fällig 25.11.2043 *	8.095	0,88	7.850 Societe Generale SA, 144A, 7,132 %, fällig 19.01.2055 *	8.068	0,88
12.697 Freddie Mac STACR Trust 2018-HQA2, Series 2018 HQA2, Class M2B, 144A, 6,766 %, fällig 25.10.2048 *	13.044	1,42		11.665	1,27
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 153.170 \$)	154.492	16,88	Israel – 2,21 % (29. Februar 2024: 2,93 %)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 59,03 % (29. Februar 2024: 57,95 %)			6.180 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	5.923	0,65
Argentinien – 1,71 % (29. Februar 2024: 0,65 %)			3.545 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, fällig 30.09.2033	3.696	0,40
3.600 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 8,500 %, fällig 24.07.2031	3.829	0,42	140 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 8,500 %, fällig 30.09.2033	146	0,02
1.138 YPF SA, 9,000 %, fällig 12.02.2026	1.162	0,13	8.600 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	8.518	0,93
5.610 YPF SA, 144A, 9,500 %, fällig 17.01.2031	6.013	0,66	1.995 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	1.953	0,21
4.530 YPF SA, 144A, 8,250 %, fällig 17.01.2034	4.602	0,50		20.236	2,21
	15.606	1,71	Mexiko – 1,73 % (29. Februar 2024: 0,55 %)		
Australien – 1,20 % (29. Februar 2024: 0,54 %)			3.227 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 5,875 %, Ewige Anleihe *	3.140	0,34
1.800 Mineral Resources Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 01.05.2027	1.802	0,20	2.140 Fideicomiso Irrevocable de Administracion y Fuente de Pago Numero CIB/4323, 144A, 11,000 %, fällig 12.09.2030	2.234	0,24
8.865 Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2028	9.184	1,00	1.387 FIEMEX Energia – Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple, 144A, 7,250 %, fällig 31.01.2041	1.392	0,15
	10.986	1,20	3.400 Grupo Posadas SAB de CV, 7,000 %, fällig 30.12.2027	3.194	0,35
Brasilien – 4,03 % (29. Februar 2024: 2,97 %)			3.200 Trust Fibra Uno, 4,869 %, fällig 15.01.2030	3.004	0,33
6.320 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, fällig 12.01.2031	6.381	0,70	2.780 Trust Fibra Uno, 144A, 7,700 %, fällig 23.01.2032	2.888	0,32
1.090 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,000 %, fällig 15.10.2034	1.047	0,11		15.852	1,73
5.270 CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig 05.12.2030	5.208	0,57	Panama – 0,41 % (29. Februar 2024: 0,28 %)		
5.423 ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	5.319	0,58	4.219 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	3.749	0,41
4.400 LD Celulose International GmbH, 144A, 7,950 %, fällig 26.01.2032	4.570	0,50	Vereinigtes Königreich – 1,22 % (29. Februar 2024: 1,08 %)		
330 Minerva Luxembourg SA, 144A, 4,375 %, fällig 18.03.2031	285	0,03	7.970 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	7.314	0,80
			GBP 1.075 Nationwide Building Society, 5,750 %, Ewige Anleihe *	1.327	0,14
			2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.545	0,28
				11.186	1,22
			USA – 35,68 % (29. Februar 2024: 27,52 %)		
			10.900 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	8.985	0,98
			5.207 Air Lease Corp, Series C, 4,125 %, Ewige Anleihe *	5.007	0,55
			7.042 Aircastle Ltd, 144A, 5,250 %, Ewige Anleihe *	6.945	0,76

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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)				Sambia – 1,78 % (29. Februar 2024: 1,57 %)				
USA – (Fortsetzung)				10.610	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	10.697	1,17	
5.732	Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	5.795	0,63	5.376	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	5.609	0,61	
6.465	Ally Financial Inc, Series B, 4,700 %, Ewige Anleihe *	6.282	0,69			16.306	1,78	
8.105	Ally Financial Inc, Series C, 4,700 %, Ewige Anleihe *	7.378	0,81	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 534.321 \$)				
2.800	AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, fällig 15.10.2028	2.981	0,33			540.138	59,03	
2.800	AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,021 %, fällig 20.10.2029	2.764	0,30	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 16,50 % (29. Februar 2024: 23,78 %)				
2.090	AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,308 %, fällig 20.10.2031	2.078	0,23	Argentinien – 1,03 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
11.676	Blue Owl Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig 17.06.2026	11.365	1,24	12.962	Argentinische Republik, Internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 09.07.2030	9.469	1,03	
2.210	Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	2.052	0,22	Brasilien – 1,93 % (29. Februar 2024: 3,36 %)				
2.820	Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.06.2029	2.667	0,29	BRL	112.000	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	17.633	1,93
16.009	Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	15.644	1,71	Kolumbien – 0,28 % (29. Februar 2024: 6,00 %)				
4.210	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	3.730	0,41	COP	12.510.000	Kolumbien, TES, Series B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	2.517	0,28
5.130	Civitas Resources Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.07.2028	5.345	0,58	Ägypten – 2,82 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
8.830	Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2032	8.879	0,97	1.370	Ägypten, Internationale Staatsanleihe, 144A, 9,450 %, fällig 04.02.2033	1.337	0,14	
7.225	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	6.903	0,75	EGP	1.300.000	Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 06.05.2025	24.511	2,68
360	Credit Acceptance Corp, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2028	385	0,04			25.848	2,82	
3.054	EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	3.275	0,36	El Salvador – 0,21 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
11.361	EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	14.165	1,55	1.295	Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 9,250 %, fällig 17.04.2030	1.378	0,15	
13.209	EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	12.382	1,35	640	Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 7,125 %, fällig 20.01.2050	544	0,06	
2.242	Embecka Corp, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2030	2.069	0,23			1.922	0,21	
7.940	Energy Transfer LP, 5,600 %, fällig 01.09.2034	8.059	0,88	Mexiko – 5,96 % (29. Februar 2024: 5,51 %)				
5.225	Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Ewige Anleihe *	5.246	0,57	MXN	354.700	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 01.03.2029	16.861	1,84
3.060	Enova International Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.08.2029	3.227	0,35	MXN	605.000	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig 26.05.2033	26.201	2,87
2.795	Enviri Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	2.712	0,30	MXN	288.600	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	11.431	1,25
8.280	Fortress Transportation and Infrastructure Investors LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01.05.2028	8.173	0,89			54.493	5,96	
12.355	Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	12.387	1,35	Panama – 2,19 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
1.950	Freedom Mortgage Holdings LLC, 144A, 8,375 %, fällig 01.04.2032	1.951	0,21	17.230	Panama, Internationale Staatsanleihe, 3,870 %, fällig 23.07.2060	9.597	1,05	
5.435	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig 12.10.2028	4.988	0,55	16.840	Panama, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 19.01.2063	10.469	1,14	
1.955	Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,000 %, fällig 15.05.2033	1.976	0,22			20.066	2,19	
4.770	Global Payments Inc, 144A, 1,500 %, fällig 01.03.2031	4.567	0,50	Vereinigtes Königreich – 2,08 % (29. Februar 2024: 5,87 %)				
12.785	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	12.726	1,39	GBP	18.870	United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	19.030	2,08
1.350	Kraken Oil & Gas Partners LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2029	1.325	0,15	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 164.125 \$)				
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	488	0,05			150.978	16,50	
7.465	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	7.521	0,82	Schuldscheindarlehen – 1,11 % (29. Februar 2024: 0,47 %)				
11.720	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig 01.02.2026	11.615	1,27	1.885	A/S Mileage Plan LP, 6,293 %, fällig 01.10.2031 *	1.891	0,21	
23.149	NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	22.894	2,50	3.140	Altice France S.A., 9,802 %, fällig 31.08.2028 *	2.826	0,31	
2.270	Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	2.328	0,26	2.270	FNZ USA Finco LLC, 9,291 %, fällig 05.11.2031 *	2.181	0,24	
2.260	Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	2.273	0,25	3.275	Star Parent Inc, 8,329 %, fällig 19.09.2030 *	3.212	0,35	
5.720	Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 5,700 %, fällig 15.09.2034	5.839	0,64	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 9.842 \$)				
2.530	PNC Financial Services Group Inc/The, Series S, 5,000 %, Ewige Anleihe *	2.527	0,28			10.110	1,11	
7.640	PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	7.135	0,78	Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,38 % (29. Februar 2024: 1,78 %)				
3.805	Prime Healthcare Services Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01.09.2029	3.606	0,39	30.962	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	30.962	3,38	
4.680	Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	4.325	0,47	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 30.962 \$)				
3.785	SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	3.786	0,41			30.962	3,38	
3.460	Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.10.2030	3.626	0,40	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 897.183 \$)				
7.455	Synchrony Financial, 7,250 %, fällig 02.02.2033	7.916	0,87			891.471	97,42	
1.010	Talos Production Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.02.2029	1.045	0,11	Devisenterminkontrakte – 0,40 % (29. Februar 2024: 0,53 %)				
9.440	United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	9.358	1,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	4.091	0,45			3.659	0,40	
2.110	Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	2.148	0,24	Futures – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				
8.250	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	7.978	0,87	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
8.370	Walgreens Boots Alliance Inc, 8,125 %, fällig 15.08.2029	8.442	0,92			713	0,08	
3.660	Walgreens Boots Alliance Inc, 3,200 %, fällig 15.04.2030	3.105	0,34	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
		326.459	35,68			895.843	97,90	
				Credit Default Swaps – 0,03 % (29. Februar 2024: 0,18 %)				
				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
						-239	-0,03	
				Devisenterminkontrakte – -0,37 % (29. Februar 2024: -0,41 %)				
				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
						-3.340	-0,37	
				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten				
						-3.579	-0,40	
				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				
						892.264	97,50	
				Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				
						22.820	2,50	
				Gesamt nettovermögen				
						915.084 \$	100,00	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 538.804.000 \$ und machten 58,85 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

ABKÜRZUNGEN:

- Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit
- BRL – Brasilianischer Real
- COP – Kolumbianischer Peso
- EGP – Ägyptisches Pfund
- 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	92,24
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,10
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,36
Derivative Finanzinstrumente	0,47
Sonstige Vermögenswerte	2,83
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	Panama, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	7.140	\$ -121
JP Morgan	Panama, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	7.020	-118
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -2.085 \$)				-239
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): -2.085 \$)				\$ -239

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
3. März 2025	BNY	Kauf USD –	Verkauf CNH 3	\$ –
6. März 2025	Citi	Kauf USD 29.799	Verkauf AUD 48.500	-296
6. März 2025	HSBC	Kauf USD 18.503	Verkauf AUD 29.360	285
6. März 2025	Morgan Stanley	Kauf AUD 77.860	Verkauf USD 50.356	-2.043
12. März 2025	HSBC	Kauf USD 27.153	Verkauf GBP 21.260	411
12. März 2025	HSBC	Kauf GBP 17.870	Verkauf USD 21.811	667
12. März 2025	JP Morgan	Kauf USD 17.343	Verkauf GBP 13.970	-230
12. März 2025	JP Morgan	Kauf GBP 1.350	Verkauf USD 1.701	-3
12. März 2025	UBS	Kauf GBP 530	Verkauf USD 655	12
14. März 2025	BNY	Kauf USD 13	Verkauf AUD 20	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 6	Verkauf CZK 150	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 513	Verkauf EUR 495	-1
14. März 2025	BNY	Kauf USD 3.694	Verkauf EUR 3.529	30
14. März 2025	BNY	Kauf USD –	Verkauf GBP –	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD –	Verkauf GBP –	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 18	Verkauf SEK 192	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 273	Verkauf SGD 371	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 1.177	Verkauf SGD 1.577	8
14. März 2025	BNY	Kauf CNH 11.926	Verkauf USD 1.634	2
14. März 2025	BNY	Kauf CZK 10.922	Verkauf USD 449	2
14. März 2025	BNY	Kauf AUD 5.671	Verkauf USD 3.565	-46
14. März 2025	BNY	Kauf CZK 586	Verkauf USD 25	–
14. März 2025	BNY	Kauf SGD 42	Verkauf USD 31	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 3.804	Verkauf USD 3.978	-33
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 271.482	Verkauf USD 280.490	1.309
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 13.962	Verkauf USD 17.297	267
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 135	Verkauf USD 172	-1
14. März 2025	BNY	Kauf CNH 54	Verkauf USD 7	–
14. März 2025	BNY	Kauf SEK 25.305	Verkauf USD 2.324	28
14. März 2025	BNY	Kauf SGD 61.847	Verkauf USD 45.724	67
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf USD 16.510	Verkauf BRL 96.510	272
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf USD 15.622	Verkauf BRL 95.810	-497
16. Apr. 2025	HSBC	Kauf BRL 95.810	Verkauf USD 15.831	289
29. Apr. 2025	Citi	Kauf USD 926	Verkauf MXN 19.200	–
29. Apr. 2025	Citi	Kauf MXN 61.200	Verkauf USD 2.943	10
29. Apr. 2025	HSBC	Kauf USD 2.026	Verkauf MXN 42.000	–
05. Mai 2025	JP Morgan	Kauf EUR 53.560	Verkauf USD 55.944	-190
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 6.119 \$)				\$ 3.659
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -4.746 \$)				-3.340
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1.373 \$)				\$ 319
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1.373 \$)				\$ 319

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2025	Citi	1.224	\$ 139.842	\$ 713
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 55 \$)				\$ 713
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -274 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -219 \$)				\$ 713

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 4,10 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
150 Bellemeade Re 2022-2 Ltd, Series 2022 2, Class M2, 144A, 13,602 %, fällig 27.09.2032 *	173	1,59	125 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	125	1,15
250 Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 10,352 %, fällig 25.10.2033 *	274	2,51	45 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.09.2031	46	0,42
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 444 \$)	447	4,10	65 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2032	65	0,60
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 14,55 % (29. Februar 2024: 28,85 %)					
100 Connecticut Avenue Securities Series 2025-R01, Series 2025 R01, Class 1B1, 144A, 6,053 %, fällig 25.01.2045 *	100	0,92	110 Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	105	0,96
110 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R03, Series 2019 R03, Class 1B1, 144A, 8,566 %, fällig 25.09.2031 *	117	1,08	130 Deluxe Corp, 144A, 8,125 %, fällig 15.09.2029	132	1,21
245 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2B1, 144A, 9,716 %, fällig 25.06.2039 *	257	2,36	200 DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig 15.11.2027	211	1,94
360 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,716 %, fällig 25.01.2040 *	373	3,42	129 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	138	1,27
600 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R05, Series 2024 R05, Class 2B1, 144A, 6,352 %, fällig 25.07.2044 *	608	5,57	80 Embecta Corp, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2030	74	0,68
70 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 2B1, 8,566 %, fällig 25.03.2031 *	77	0,71	35 Enova International Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.08.2029	37	0,34
50 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B1, 144A, 9,102 %, fällig 25.02.2042 *	53	0,49	100 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	98	0,90
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.559 \$)	1.585	14,55	110 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	110	1,01
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 71,47 % (29. Februar 2024: 62,22 %)					
Argentinien – 3,44 % (29. Februar 2024: 2,58 %)					
85 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 8,500 %, fällig 24.07.2031	90	0,83	25 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,000 %, fällig 15.05.2033	25	0,23
75 YPF Energia Electrica SA, 144A, 7,875 %, fällig 16.10.2032	76	0,70	100 Golub Capital BDC Inc, 6,000 %, fällig 15.07.2029	102	0,93
105 YPF SA, 9,000 %, fällig 12.02.2026	107	0,98	55 Golub Capital Private Credit Fund, 144A, 5,875 %, fällig 01.05.2030	55	0,50
100 YPF SA, 144A, 8,250 %, fällig 17.01.2034	101	0,93	85 Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026	85	0,78
	374	3,44	40 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	42	0,38
Australien – 0,81 % (29. Februar 2024: 1,28 %)					
85 Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2028	88	0,81	70 Kraken Oil & Gas Partners LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2029	69	0,63
Brasilien – 3,98 % (29. Februar 2024: 4,04 %)					
200 Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, fällig 12.01.2031	202	1,85	30 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2027	30	0,28
200 CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig 05.12.2030	198	1,81	55 Long Ridge Energy LLC, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2032	55	0,51
35 ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	34	0,32	65 Manitowoc Co Inc/The, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2031	68	0,63
	434	3,98	30 Mativ Holdings Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2029	28	0,25
Kanada – 7,52 % (29. Februar 2024: 4,05 %)					
105 Bank of Nova Scotia/The, 4,900 %, Ewige Anleihe *	105	0,96	130 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig 01.02.2026	129	1,18
130 Baytex Energy Corp, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2030	133	1,22	226 NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	224	2,05
124 Saturn Oil & Gas Inc, 144A, 9,625 %, fällig 15.06.2029	122	1,12	100 NGL Energy Operating LLC / NGL Energy Finance Corp, 144A, 8,125 %, fällig 15.02.2029	102	0,93
130 Strathcona Resources Ltd/Alberta, 144A, 6,875 %, fällig 01.08.2026	131	1,20	105 PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	109	1,00
100 Taseko Mines Ltd, 144A, 8,250 %, fällig 01.05.2030	104	0,96	125 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	119	1,10
230 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	224	2,06	104 Sabre GBL Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2027	107	0,98
	819	7,52	46 Sabre GBL Inc, 10,750 %, fällig 15.11.2029	49	0,45
Kolumbien – 1,27 % (29. Februar 2024: 1,55 %)					
140 Ecopetrol SA, 7,750 %, fällig 01.02.2032	139	1,27	50 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	46	0,42
Deutschland – 1,25 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
130 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	137	1,25	135 SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	135	1,24
Israel – 1,27 % (29. Februar 2024: 3,25 %)					
140 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	139	1,27	90 Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.10.2030	94	0,87
Mexiko – 7,34 % (29. Februar 2024: 3,01 %)					
200 Fideicomiso Irrevocable de Administracion y Fuente de Pago Numero CIB/4323, 144A, 11,000 %, fällig 12.09.2030	209	1,92	181 Transocean Titan Financing Ltd, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	185	1,70
199 FIEMEX Energia – Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple, 144A, 7,250 %, fällig 31.01.2041	199	1,83	25 Turning Point Brands Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.03.2032	26	0,24
150 Grupo Posadas SAB de CV, 7,000 %, fällig 30.12.2027	141	1,29	130 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	126	1,16
270 Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	251	2,30	125 Velocity Vehicle Group LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.06.2029	131	1,20
	800	7,34	30 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	30	0,28
Peru – 1,21 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19.06.2047	132	1,21	80 Walgreens Boots Alliance Inc, 3,200 %, fällig 15.04.2030	68	0,62
Vereinigtes Königreich – 1,68 % (29. Februar 2024: 1,32 %)					
200 Connect Finco SARRL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	183	1,68	66 Wildfire Intermediate Holdings LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.10.2029	66	0,60
USA – 39,78 % (29. Februar 2024: 38,54 %)					
230 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	190	1,74	4.335	39,78	
55 Air Lease Corp, Series B, 4,650 %, Ewige Anleihe *	54	0,50	Sambia – 1,92 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
110 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	111	1,02	200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	209	1,92
75 Ally Financial Inc, Series B, 4,700 %, Ewige Anleihe *	73	0,67	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 7.657 \$)		
150 AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 10,250 %, fällig 15.10.2028	160	1,47	7.789	71,47	
110 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	101	0,93	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 5,38 % (29. Februar 2024: 6,85 %)		
70 AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,021 %, fällig 20.10.2029	69	0,63	Argentinien – 1,06 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
70 AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,308 %, fällig 20.10.2031	70	0,64	158 Argentinische Republik, Internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 09.07.2030	116	1,06
30 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	28	0,26	Ägypten – 2,89 % (29. Februar 2024: 1,10 %)		
35 Central Parent LLC / CDK Global II LLC / CDK Financing Co Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.06.2029	33	0,30	EGP 15.975 Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.03.2025	314	2,89
			Panama – 1,43 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
			280 Panama, Internationale Staatsanleihe, 3,870 %, fällig 23.07.2060	156	1,43
			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 598 \$)		
			586	5,38	
			Schuldscheindarlehen – 1,56 % (29. Februar 2024: 4,06 %)		
			170 Westjet Loyalty LP, 7,579 %, fällig 14.02.2031 *	170	1,56
			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 168 \$)		
			170	1,56	
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,31 % (29. Februar 2024: 7,70 %)		
			470 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	470	4,31
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 470 \$)		
			470	4,31	
			Stammaktien – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,07 %)		
			USA – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,07 %)		
			1 New Fortress Energy Inc 'A' ∞	13	0,12
			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)		
			13	0,12	
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 10.896 \$)		
			11.060	101,49	
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
			11.060	101,49	

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Credit Default Swaps – 0,73 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-80	-0,73
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-80	-0,73
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	10.980	100,76
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-83	-0,76
Gesamt Nettovermögen	10.897 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.357.000 \$ und machten 76,70 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.

∞ 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.

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

EGP – Ägyptisches Pfund

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,96
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,52
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,19
Sonstige Vermögenswerte	1,33
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeits- datum	Nominal- betrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	Panama, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2033	660	\$ -80
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				-80
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				\$ -80

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^Ω

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
Pipelines – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
2 New Fortress Energy Inc 'A' ∞	15
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	15
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-15
Gesamtneuvermögen	\$ –

-
- 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 %.
- ∞
- Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- Ω
- Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ den Handel ein.

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	22,73
Sonstige Vermögenswerte	77,27
Gesamtvermögen	100,00

^ 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 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 37,27 % (29. Februar 2024: 42,78 %)			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 51,30 % (29. Februar 2024: 45,16 %)			
USA – 51,30 % (29. Februar 2024: 45,16 %)			USA – 51,30 % (29. Februar 2024: 45,16 %)			
1.527	Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	1.555	4,22	4.560	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe	
1.229	Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig 20.11.2053	1.251	3,40	4.501	%, fällig 31.10.2026 *	4.570
373	Ginnie Mae II Pool 'MA9606', 6,000 %, fällig 20.04.2054	378	1,03	4.060	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	3.979
1.185	Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	1.204	3,27	6.690	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	6.526
679	Ginnie Mae II Pool 'MA9726', 6,000 %, fällig 20.06.2054	690	1,87	5.030	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	3.814
1.482	Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	1.504	4,09			18.889
1.013	Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	1.028	2,79			51,30
1.064	Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	1.080	2,93	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 18.879 \$)		
741	Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	753	2,05	18.889		51,30
1.063	Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	1.079	2,93	Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,02 % (29. Februar 2024: 3,28 %)		
1.604	Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	1.628	4,42	742	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2,02
558	Ginnie Mae II Pool 'MB0148', 6,000 %, fällig 20.01.2055	567	1,54	742		2,02
990	Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	1.005	2,73	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 742 \$)		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 13.641 \$)			13.722	37,27	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 36.498 \$)	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 8,84 % (29. Februar 2024: 5,55 %)			Futures – 0,06 % (29. Februar 2024: 0,05 %)			
Kanada – 0,92 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
340	Bank of Nova Scotia/The, 4,900 %, Ewige Anleihe *	339	0,92	22		0,06
Schweiz – 0,53 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
200	UBS Group AG, 144A, 3,875 %, Ewige Anleihe *	195	0,53	36.629		99,49
Vereinigtes Königreich – 0,68 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
50	BAT Capital Corp, 3,462 %, fällig 06.09.2029	48	0,13	36.629		99,49
200	NatWest Group Plc, Series A–, 8,000 %, Ewige Anleihe *	202	0,55	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
		250	0,68	188		0,51
USA – 6,71 % (29. Februar 2024: 5,55 %)			Gesamtvermögen			
55	American Express Co, 3,550 %, Ewige Anleihe *	53	0,15	36.817	\$	100,00
40	Ares Capital Corp, 7,000 %, fällig 15.01.2027	41	0,11	– 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 %.		
100	Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	94	0,25	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 195.000 \$ und machten 0,53 % des Nettovermögens aus.		
120	Blue Owl Capital Corp, 2,875 %, fällig 11.06.2028	111	0,30	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.		
115	Boeing Co/The, 3,200 %, fällig 01.03.2029	108	0,29	ABKÜRZUNGEN:		
80	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	80	0,22	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
310	Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	303	0,82	Verteilung des Gesamtvermögens		
50	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	49	0,13	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
130	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,100 %, fällig 01.06.2029	134	0,37	Organismen für gemeinsame Anlagen		
100	Citizens Financial Group Inc, 5,841 %, fällig 23.01.2030 *	103	0,28	Derivative Finanzinstrumente		
70	Devon Energy Corp, 7,875 %, fällig 30.09.2031	80	0,22	Sonstige Vermögenswerte		
300	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	289	0,79	Gesamtvermögen		
70	Occidental Petroleum Corp, 5,200 %, fällig 01.08.2029	70	0,19	100,00		
100	Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	106	0,29			
680	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 05.18.2026	682	1,85			
170	Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	167	0,45			
		2.470	6,71			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 3.236 \$)			3.254	8,84		

Aufstellung der Terminkontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2025	Citi	44	\$ 4.749
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 14 \$)			\$ 22
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 14 \$)			\$ 22

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 91,47 % (29. Februar 2024: 96,91 %)		
Banken – 5,40 % (29. Februar 2024: 6,31 %)		
779 Bank of America Corp	35.934	2,96
829 First Horizon Corp	17.872	1,47
62 M&T Bank Corp	11.801	0,97
	65.607	5,40
Getränke – 1,13 % (29. Februar 2024: 1,22 %)		
78 Constellation Brands Inc 'A'	13.740	1,13
Biotechnologie – 5,20 % (29. Februar 2024: 4,75 %)		
22 Argenx SE ADR	13.972	1,15
271 Corvea Inc	17.087	1,40
281 Gilead Sciences Inc	32.164	2,65
	63.223	5,20
Baumaterialien – 2,18 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
165 Fortune Brands Innovations Inc	10.684	0,88
185 Johnson Controls International plc	15.836	1,30
	26.520	2,18
Chemie – 1,11 % (29. Februar 2024: 1,70 %)		
138 Eastman Chemical Co	13.531	1,11
Kohle – 1,26 % (29. Februar 2024: 1,02 %)		
379 Teck Resources Ltd	15.298	1,26
Gewerbliche Dienstleistungen – 5,96 % (29. Februar 2024: 2,11 %)		
241 Block Inc	15.708	1,29
152 Global Payments Inc	15.966	1,32
354 GXO Logistics Inc	13.968	1,15
227 PayPal Holdings Inc	16.152	1,33
322 WillScot Holdings Corp	10.595	0,87
	72.389	5,96
Computer – 1,06 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
126 Seagate Technology Holdings Plc	12.896	1,06
Kosmetik u. Körperpflege – 0,14 % (29. Februar 2024: 1,10 %)		
294 Coty Inc	1.677	0,14
Distribution u. Großhandel – 1,76 % (29. Februar 2024: 1,41 %)		
JPY 608 Marubeni Corp	9.577	0,79
65 WESCO International Inc	11.784	0,97
	21.361	1,76
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,58 % (29. Februar 2024: 5,19 %)		
89 Capital One Financial Corp	17.928	1,48
230 Charles Schwab Corp/The	18.253	1,50
361 OneMain Holdings Inc	19.437	1,60
	55.618	4,58
Strom – 4,63 % (29. Februar 2024: 8,30 %)		
1.065 PG&E Corp	17.401	1,43
514 PPL Corp	18.098	1,49
61 Talen Energy Corp	12.584	1,04
61 Vistra Corp	8.132	0,67
	56.215	4,63
Energie – 1,45 % (29. Februar 2024: 1,74 %)		
178 ConocoPhillips	17.656	1,45
Unterhaltung – 1,12 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
310 DraftKings Inc	13.622	1,12
Umweltkontrolle – 1,28 % (29. Februar 2024: 1,25 %)		
73 Clean Harbors Inc	15.606	1,28
Ernährung – 3,00 % (29. Februar 2024: 2,08 %)		
258 Nestle SA ADR	24.849	2,04
136 Performance Food Group Co	11.604	0,96
	36.453	3,00
Gesundheit – Produkte – 1,15 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
152 Medtronic Plc	13.940	1,15
Gesundheit – Dienstleistungen – 3,22 % (29. Februar 2024: 1,11 %)		
61 ICON Plc	11.524	0,95
58 UnitedHealth Group Inc	27.632	2,27
	39.156	3,22
Versicherung – 8,35 % (29. Februar 2024: 7,89 %)		
296 American International Group Inc	24.544	2,02
829 Corebridge Financial Inc	28.776	2,37
CAD 12 Fairfax Financial Holdings Ltd	17.094	1,41
718 MGIC Investment Corp	17.660	1,45
192 Ryan Specialty Holdings Inc 'A'	13.444	1,10
	101.518	8,35
Internet – 2,73 % (29. Februar 2024: 5,60 %)		
25 Meta Platforms Inc 'A'	16.966	1,40
213 Uber Technologies Inc	16.193	1,33
	33.159	2,73

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Medien – 0,81 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
86 Walt Disney Co/The	9.798	0,81
Bergbau – 1,27 % (29. Februar 2024: 2,17 %)		
418 Freeport-McMoRan Inc	15.431	1,27
Fertigung diverse – 1,63 % (29. Februar 2024: 1,90 %)		
EUR 87 Siemens AG	19.834	1,63
Öl u. Gas – 4,91 % (29. Februar 2024: 7,51 %)		
507 EQT Corp	24.447	2,01
137 Hess Corp	20.480	1,69
570 Noble Corp Plc	14.765	1,21
	59.692	4,91
Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,96 % (29. Februar 2024: 1,42 %)		
302 Atlas Energy Solutions Inc	5.861	0,48
432 Schlumberger NV	18.003	1,48
	23.864	1,96
Verpackung u. Behälter – 0,57 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
127 Silgan Holdings Inc	6.918	0,57
Pharma – 9,08 % (29. Februar 2024: 6,75 %)		
120 AbbVie Inc	25.126	2,07
335 CVS Health Corp	22.051	1,81
206 Johnson & Johnson	33.995	2,80
185 Novo Nordisk A.S ADR	16.805	1,38
EUR 65 UCB SA	12.356	1,02
	110.333	9,08
Pipelines – 2,49 % (29. Februar 2024: 0,83 %)		
885 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	19.103	1,57
737 Venture Global Inc	11.142	0,92
	30.245	2,49
Immobilien – 1,02 % (29. Februar 2024: 0,77 %)		
46 Jones Lang LaSalle Inc	12.445	1,02
Einzelhandel – 2,93 % (29. Februar 2024: 1,13 %)		
102 Genuine Parts Co	12.739	1,05
24 Murphy USA Inc	11.224	0,92
94 Target Corp	11.622	0,96
	35.585	2,93
Halbleiter – 2,70 % (29. Februar 2024: 3,77 %)		
210 Microchip Technology Inc	12.344	1,02
219 Micron Technology Inc	20.485	1,68
	32.829	2,70
Software – 2,97 % (29. Februar 2024: 5,75 %)		
82 Fiserv Inc	19.301	1,59
101 Oracle Corp	16.830	1,38
	36.131	2,97
Telekommunikation – 1,29 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
58 T-Mobile US Inc	15.647	1,29
Transportwesen – 1,13 % (29. Februar 2024: 4,68 %)		
176 Canadian Pacific Kansas City Ltd	13.728	1,13
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.024.261 \$)		
	1.111.665	91,47
Real Estate Investment Trusts – 2,36 % (29. Februar 2024: 1,75 %)		
REITS – 2,36 % (29. Februar 2024: 1,75 %)		
273 American Homes 4 Rent 'A'	10.103	0,83
91 American Tower Corp	18.661	1,53
	28.764	2,36
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 27.685 \$)		
	28.764	2,36
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.051.946 \$)		
	1.140.429	93,83
Devisenterminkontrakte – 0,07 % (29. Februar 2024: 0,05 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	802	0,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	1.141.231	93,90
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-2	-
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-2	-
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	1.141.229	93,90
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	74.140	6,10
Gesamt Nettovermögen		
	1.215.369 \$	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 %.

Master Limited Partnership.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
JPY	– Japanischer Yen

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,65
Derivative Finanzinstrumente	0,07
Sonstige Vermögenswerte	7,28
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 42.062	Verkauf	EUR 40.214	\$ 321	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 4	Verkauf	EUR 4	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 36	Verkauf	SGD 48	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 29	Verkauf	USD 21	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 2.148	Verkauf	USD 1.588	2	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 232	Verkauf	USD 244	-2	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 96.428	Verkauf	USD 99.613	479	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 622 \$)						\$ 802	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -6 \$)						-2	
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 616 \$)						\$ 800	

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 97,69 % (29. Februar 2024: 98,28 %)		
Automobilhersteller – 0,46 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
3 Tesla Inc	844	0,46
Banken – 6,64 % (29. Februar 2024: 5,08 %)		
94 Bank of America Corp	4.338	2,39
22 JPMorgan Chase & Co	5.854	3,22
40 US Bancorp	1.879	1,03
	12.071	6,64
Getränke – 2,38 % (29. Februar 2024: 2,29 %)		
31 Coca-Cola Co/The	2.176	1,20
14 PepsiCo Inc	2.154	1,18
	4.330	2,38
Baumaterialien – 1,25 % (29. Februar 2024: 1,03 %)		
9 Vulcan Materials Co	2.264	1,25
Chemie – 2,97 % (29. Februar 2024: 3,50 %)		
7 Ecolab Inc	1.898	1,04
4 Linde Plc	1.979	1,09
4 Sherwin-Williams Co/The	1.526	0,84
	5.403	2,97
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,05 % (29. Februar 2024: 1,72 %)		
12 Automatic Data Processing Inc	3.719	2,05
Computer – 6,05 % (29. Februar 2024: 5,17 %)		
45 Apple Inc	11.003	6,05
Kosmetik u. Körperpflege – 1,30 % (29. Februar 2024: 1,39 %)		
14 Procter & Gamble Co/The	2.364	1,30
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,22 % (29. Februar 2024: 5,03 %)		
4 CME Group Inc	1.017	0,56
14 Intercontinental Exchange Inc	2.366	1,30
17 Visa Inc 'A'	6.105	3,36
	9.488	5,22
Strom – 1,64 % (29. Februar 2024: 1,06 %)		
14 NextEra Energy Inc	968	0,53
19 WEC Energy Group Inc	2.018	1,11
	2.986	1,64
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 3,11 % (29. Februar 2024: 2,74 %)		
9 Eaton Corp Plc	2.618	1,44
25 Emerson Electric Co	3.025	1,67
	5.643	3,11
Elektronik – 1,91 % (29. Februar 2024: 2,09 %)		
16 Honeywell International Inc	3.478	1,91
Umweltkontrolle – 1,82 % (29. Februar 2024: 1,89 %)		
14 Waste Management Inc	3.315	1,82
Ernährung – 0,28 % (29. Februar 2024: 1,16 %)		
6 McCormick & Co Inc/MD	505	0,28
Gesundheit – Produkte – 2,63 % (29. Februar 2024: 2,79 %)		
7 Stryker Corp	2.601	1,43
4 Thermo Fisher Scientific Inc	2.170	1,20
	4.771	2,63
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,17 % (29. Februar 2024: 1,96 %)		
4 UnitedHealth Group Inc	2.121	1,17
Versicherung – 6,65 % (29. Februar 2024: 8,08 %)		
– Berkshire Hathaway Inc	6.167	3,39
6 Progressive Corp/The	1.731	0,95
16 Travelers Cos Inc/The	4.185	2,31
	12.083	6,65
Internet – 12,32 % (29. Februar 2024: 10,89 %)		
13 Alphabet Inc	2.198	1,21
21 Alphabet Inc 'A'	3.492	1,92
40 Amazon.com Inc	8.548	4,70
9 Meta Platforms Inc 'A'	5.773	3,18
2 Netflix Inc	2.373	1,31
	22.384	12,32
Medien – 1,71 % (29. Februar 2024: 1,67 %)		
27 Walt Disney Co/The	3.113	1,71
Öl u. Gas – 0,67 % (29. Februar 2024: 1,16 %)		
12 ConocoPhillips	1.226	0,67
Verpackung u. Behälter – 0,84 % (29. Februar 2024: 0,67 %)		
17 Crown Holdings Inc	1.527	0,84

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Pharma – 6,22 % (29. Februar 2024: 9,39 %)		
13 AbbVie Inc	2.678	1,47
5 Eli Lilly & Co	4.586	2,53
18 Johnson & Johnson	3.041	1,67
11 Merck & Co Inc	1.006	0,55
	11.311	6,22
Pipelines – 1,25 % (29. Februar 2024: 0,70 %)		
84 Kinder Morgan Inc	2.266	1,25
Einzelhandel – 6,25 % (29. Februar 2024: 5,30 %)		
9 BJ's Wholesale Club Holdings Inc	953	0,53
1 Costco Wholesale Corp	1.053	0,58
9 Starbucks Corp	1.060	0,58
5 Target Corp	570	0,31
36 TJX Cos Inc/The	4.460	2,46
33 Walmart Inc	3.260	1,79
	11.356	6,25
Halbleiter – 7,81 % (29. Februar 2024: 5,32 %)		
3 ASML Holding NV	2.320	1,28
19 Broadcom Inc	3.880	2,13
9 Marvell Technology Inc	840	0,46
57 NVIDIA Corp	7.158	3,94
	14.198	7,81
Software – 10,49 % (29. Februar 2024: 12,46 %)		
35 Microsoft Corp	13.732	7,56
11 Oracle Corp	1.879	1,03
5 Synopsys Inc	2.511	1,38
4 Workday Inc 'A'	937	0,52
	19.059	10,49
Telekommunikation – 1,51 % (29. Februar 2024: 1,42 %)		
17 Arista Networks Inc	1.618	0,89
4 T-Mobile US Inc	1.126	0,62
	2.744	1,51
Transportwesen – 1,09 % (29. Februar 2024: 2,32 %)		
12 Canadian Pacific Kansas City Ltd	928	0,51
4 Union Pacific Corp	1.055	0,58
	1.983	1,09
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 119.869 \$)		
	177.555	97,69
Real Estate Investment Trusts – 1,07 % (29. Februar 2024: 1,12 %)		
9 American Tower Corp	1.951	1,07
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.141 \$)		
	1.951	1,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	179.506	98,76
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	179.506	98,76
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	2.254	1,24
Gesamtnettovermögen		
	181.760 \$	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 %.

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,22
Sonstige Vermögenswerte	1,78
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 96,02 % (29. Februar 2024: 96,11 %)		
Automobilhersteller – 1,53 % (29. Februar 2024: 0,53 %)		
104 Tesla Inc	30.593	1,53
Getränke – 1,28 % (29. Februar 2024: 1,52 %)		
469 Monster Beverage Corp	25.625	1,28
Chemie – 1,66 % (29. Februar 2024: 1,87 %)		
92 Sherwin-Williams Co/The	33.221	1,66
Gewerbliche Dienstleistungen – 3,38 % (29. Februar 2024: 2,63 %)		
453 PayPal Holdings Inc	32.157	1,61
66 S&P Global Inc	35.462	1,77
	67.619	3,38
Computer – 6,76 % (29. Februar 2024: 3,91 %)		
83 Accenture Plc 'A'	28.995	1,45
439 Apple Inc	106.109	5,31
	135.104	6,76
Distribution u. Großhandel – 1,86 % (29. Februar 2024: 2,52 %)		
36 VWW Grainger Inc	37.135	1,86
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,98 % (29. Februar 2024: 5,29 %)		
275 Visa Inc 'A'	99.623	4,98
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,74 % (29. Februar 2024: 2,34 %)		
118 Eaton Corp Plc	34.710	1,74
Elektronik – 1,50 % (29. Februar 2024: 1,44 %)		
141 Honeywell International Inc	29.958	1,50
Gesundheit – Produkte – 6,02 % (29. Februar 2024: 7,98 %)		
87 Alcon Inc	8.002	0,40
81 Intuitive Surgical Inc	46.448	2,32
94 Stryker Corp	36.333	1,82
56 Thermo Fisher Scientific Inc	29.541	1,48
	120.324	6,02
Gesundheit – Dienstleistungen – 2,60 % (29. Februar 2024: 2,70 %)		
44 ICON Plc	8.276	0,41
92 UnitedHealth Group Inc	43.790	2,19
	52.066	2,60
Versicherung – 1,50 % (29. Februar 2024: 1,40 %)		
126 Marsh & McLennan Cos Inc	29.986	1,50
Internet – 26,73 % (29. Februar 2024: 22,55 %)		
185 Airbnb Inc	25.671	1,28
214 Alphabet Inc 'A'	36.432	1,82
802 Amazon.com Inc	170.256	8,51
211 Meta Platforms Inc 'A'	140.877	7,05
78 Netflix Inc	76.521	3,83
263 Palo Alto Networks Inc	50.013	2,50
459 Uber Technologies Inc	34.864	1,74
	534.634	26,73
Pharma – 3,45 % (29. Februar 2024: 3,25 %)		
27 Eli Lilly & Co	24.861	1,24
182 Novo Nordisk A.S ADR	16.483	0,82
166 Zoetis Inc	27.732	1,39
	69.076	3,45

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Einzelhandel – 1,83 % (29. Februar 2024: 1,56 %)		
117 Starbucks Corp	13.503	0,67
186 Target Corp	23.154	1,16
	36.657	1,83
Halbleiter – 11,97 % (29. Februar 2024: 11,28 %)		
45 ASML Holding NV	31.877	1,59
1.373 NVIDIA Corp	171.647	8,58
199 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	35.953	1,80
	239.477	11,97
Software – 15,64 % (29. Februar 2024: 16,82 %)		
45 Adobe Inc	19.825	0,99
65 Intuit Inc	39.907	2,00
350 Microsoft Corp	139.098	6,95
176 Salesforce Inc	52.303	2,61
54 Synopsys Inc	24.733	1,24
141 Workday Inc 'A'	37.004	1,85
	312.870	15,64
Transportwesen – 1,59 % (29. Februar 2024: 2,39 %)		
129 Union Pacific Corp	31.722	1,59
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.137.352 \$)		
	1.920.400	96,02
Real Estate Investment Trusts – 1,38 % (29. Februar 2024: 1,50 %)		
REITS – 1,38 % (29. Februar 2024: 1,50 %)		
31 Equinix Inc	27.668	1,38
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 20.418 \$)		
	27.668	1,38
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.157.770 \$)		
	1.948.068	97,40
Devisenterminkontrakte – 0,10 % (29. Februar 2024: 0,02 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1.978	0,10
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	1.950.046	97,50
Devisenterminkontrakte – -0,07 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-1.354	-0,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-1.354	-0,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	1.948.692	97,43
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	51.289	2,57
Gesamtvermögen		
	1.999.981 \$	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

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,00
Derivative Finanzinstrumente	0,10
Sonstige Vermögenswerte	2,90
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
5. März 2025	BNY	Kauf	USD 47.515	Verkauf BRL 272.400 \$ 1.283
5. März 2025	BNY	Kauf	BRL 28.841	Verkauf USD 4.952 -57
5. März 2025	BNY	Kauf	BRL 243.559	Verkauf USD 41.171 167
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 5.441	Verkauf EUR 5.231 10
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 208	Verkauf EUR 200 –
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 1.966	Verkauf USD 2.056 -14
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 99.852	Verkauf USD 103.150 497
02. Apr. 2025	BNY	Kauf	USD 1.721	Verkauf BRL 10.083 21
02. Apr. 2025	BNY	Kauf	BRL 264.956	Verkauf USD 45.951 -1.283
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 392 \$)				\$ 1.978
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -312 \$)				-1.354
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 80 \$)				\$ 624

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 99,25 % (29. Februar 2024: 98,91 %)		
Biotechnologie – 7,76 % (29. Februar 2024: 12,44 %)		
12 Ionis Pharmaceuticals Inc	402	0,23
41 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	1.777	1,00
24 Vertex Pharmaceuticals Inc	11.539	6,53
	13.718	7,76
Baumaterialien – 4,22 % (29. Februar 2024: 2,53 %)		
14 Builders FirstSource Inc	1.974	1,12
64 Johnson Controls International plc	5.483	3,10
	7.457	4,22
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,72 % (29. Februar 2024: 1,79 %)		
18 Cintas Corp	3.653	2,07
6 Paylocity Holding Corp	1.145	0,65
	4.798	2,72
Computer – 6,54 % (29. Februar 2024: 11,88 %)		
10 Accenture Plc 'A'	3.447	1,95
20 CrowdStrike Holdings Inc	7.616	4,31
5 Seagate Technology Holdings Plc	495	0,28
	11.558	6,54
Kosmetik u. Körperpflege – 0,78 % (29. Februar 2024: 0,25 %)		
20 elf Beauty Inc	1.384	0,78
Distribution u. Großhandel – 2,37 % (29. Februar 2024: 1,08 %)		
4 VWW Grainger Inc	4.186	2,37
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,24 % (29. Februar 2024: 0,74 %)		
23 Ares Management Corp 'A'	3.913	2,21
21 Cohen & Steers Inc	1.818	1,03
	5.731	3,24
Elektronik – 5,26 % (29. Februar 2024: 5,22 %)		
60 TE Connectivity Plc	9.297	5,26
Unterhaltung – 3,30 % (29. Februar 2024: 4,05 %)		
43 Madison Square Garden Entertainment Corp 'A'	1.501	0,85
21 Madison Square Garden Sports Corp	4.332	2,45
	5.833	3,30
Umweltkontrolle – 0,82 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
7 Clean Harbors Inc	1.453	0,82
Gesundheit – Produkte – 2,69 % (29. Februar 2024: 1,07 %)		
4 IDEXX Laboratories Inc	1.704	0,97
11 Insulet Corp	3.042	1,72
	4.746	2,69
Gesundheit – Dienstleistungen – 3,19 % (29. Februar 2024: 7,81 %)		
4 Charles River Laboratories International Inc	724	0,41
10 UnitedHealth Group Inc	4.904	2,78
	5.628	3,19
Internet – 8,45 % (29. Februar 2024: 6,61 %)		
34 Airbnb Inc	4.739	2,68
118 Pinterest Inc	4.350	2,46
43 Robinhood Markets Inc	2.170	1,23
33 Shopify Inc 'A'	3.672	2,08
	14.931	8,45
Maschinen – Bau u. Bergbau – 2,33 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
43 Vertiv Holdings Co 'A'	4.123	2,33
Medien – 2,18 % (29. Februar 2024: 5,38 %)		
40 Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	3.849	2,18
Bergbau – 2,22 % (29. Februar 2024: 1,94 %)		
106 Freeport-McMoRan Inc	3.926	2,22
Einzelhandel – 9,57 % (29. Februar 2024: 3,57 %)		
10 Cava Group Inc	988	0,56
55 Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	2.978	1,68
27 Starbucks Corp	3.127	1,77
55 TJX Cos Inc/The	6.799	3,85
55 Tractor Supply Co	3.017	1,71
	16.909	9,57
Halbleiter – 6,65 % (29. Februar 2024: 9,12 %)		
59 Broadcom Inc	11.757	6,65
Software – 23,07 % (29. Februar 2024: 18,15 %)		
12 AppLovin Corp 'A'	4.008	2,27
27 Autodesk Inc	7.370	4,17
27 DocuSign Inc 'A'	2.270	1,28
43 Doximity Inc	3.031	1,71
12 HubSpot Inc	8.796	4,98
5 MongoDB Inc 'A'	1.257	0,71
6 MSCI Inc 'A'	3.541	2,00
39 Palantir Technologies Inc	3.320	1,88

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
5 ServiceNow Inc	4.269	2,42
16 Snowflake Inc	2.914	1,65
	40.776	23,07
Telekommunikation – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
24 GCI Liberty, Inc. Treuhandkonto ∞	–	–
Transportwesen – 1,89 % (29. Februar 2024: 0,15 %)		
19 Old Dominion Freight Line Inc	3.335	1,89
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 124.040 \$)	175.395	99,25
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 124.040 \$)		
	175.395	99,25
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	21	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	175.416	99,26
Devisenterminkontrakte – -0,02 % (29. Februar 2024: -0,01 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-46	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-46	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	175.370	99,24
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	1.359	0,76
Gesamtnettovermögen		
	176.729 \$	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 %.

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,59
Derivative Finanzinstrumente	0,01
Sonstige Vermögenswerte	1,40
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
3. März 2025	BNY	Kauf	CNH	538	Verkauf	USD	74	\$	-1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	355	Verkauf	AUD	559		7
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	6	Verkauf	CHF	6		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	103	Verkauf	CNH	746		1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	23	Verkauf	CNH	169		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	170	Verkauf	EUR	163		1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	15	Verkauf	EUR	15		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	14	Verkauf	GBP	11		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	10		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	2	Verkauf	SEK	23		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	110	Verkauf	SGD	147		1
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	790	Verkauf	USD	816		4
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	–	Verkauf	USD	–		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SEK	307	Verkauf	USD	28		–
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH	5.066	Verkauf	USD	694		1
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF	3	Verkauf	USD	3		–
14. März 2025	BNY	Kauf	CHF	60	Verkauf	USD	66		1
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD	5.652	Verkauf	USD	3.553		-45
14. März 2025	BNY	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	–		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	1.781	Verkauf	USD	1.317		2
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	2	Verkauf	USD	1		–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	151	Verkauf	USD	187		3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 7 \$)								\$	21
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -22 \$)									-46
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -15 \$)								\$	-25

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 77,38 % (29. Februar 2024: 78,82 %)			Software – 7,03 % (29. Februar 2024: 7,48 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,56 % (29. Februar 2024: 1,06 %)			– Intuit Inc	211	0,52
2 L3Harris Technologies Inc	371	0,92	3 Microsoft Corp	1.031	2,55
1 Northrop Grumman Corp	259	0,64	6 Oracle Corp	972	2,40
	630	1,56	2 Salesforce Inc	631	1,56
				2.845	7,03
Banken – 5,25 % (29. Februar 2024: 2,59 %)			Telekommunikation – 1,83 % (29. Februar 2024: 1,31 %)		
12 Bank of America Corp	562	1,39	3 T-Mobile US Inc	739	1,83
7 Citigroup Inc	590	1,46			
4 JPMorgan Chase & Co	972	2,40	Transportwesen – 1,68 % (29. Februar 2024: 2,86 %)		
	2.124	5,25	3 Union Pacific Corp	678	1,68
Getränke – 1,07 % (29. Februar 2024: 1,97 %)				31.289	77,38
6 Coca-Cola Co/The	432	1,07	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 21.953 \$)		
Biotechnologie – 0,76 % (29. Februar 2024: 1,30 %)			Vorzugsaktien – 8,53 % (29. Februar 2024: 5,31 %)		
1 Amgen Inc	309	0,76	Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,56 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Computer – 2,48 % (29. Februar 2024: 4,12 %)			10 Boeing Co/The	629	1,56
4 Apple Inc	1.001	2,48	Computer – 1,54 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Kosmetik u. Körperpflege – 2,80 % (29. Februar 2024: 3,29 %)			11 Hewlett Packard Enterprise Co	624	1,54
4 Colgate-Palmolive Co	392	0,97	Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,94 % (29. Februar 2024: 2,92 %)		
4 Procter & Gamble Co/The	740	1,83	13 Apollo Global Management Inc	1.042	2,58
	1.132	2,80	10 Ares Management Corp, Series B	551	1,36
				1.593	3,94
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,15 % (29. Februar 2024: 4,35 %)			Strom – 1,49 % (29. Februar 2024: 1,72 %)		
43 Blue Owl Capital Inc 'A'	914	2,26	15 NextEra Energy Inc	601	1,49
4 Charles Schwab Corp/The	296	0,73		3.447	8,53
3 Intercontinental Exchange Inc	467	1,16	Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 3.065 \$)		
	1.677	4,15	Real Estate Investment Trusts – 10,18 % (29. Februar 2024: 15,65 %)		
Strom – 2,14 % (29. Februar 2024: 4,59 %)			REITS – 10,18 % (29. Februar 2024: 15,65 %)		
19 PPL Corp	664	1,64	2 Alexandria Real Estate Equities Inc	229	0,57
2 Public Service Enterprise Group Inc	201	0,50	15 American Homes 4 Rent 'A'	539	1,33
	865	2,14	2 American Tower Corp	484	1,20
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,45 % (29. Februar 2024: 1,39 %)			2 Digital Realty Trust Inc	302	0,75
5 Emerson Electric Co	585	1,45	1 Equinix Inc	573	1,42
Elektronik – 1,41 % (29. Februar 2024: 0,56 %)			8 Equity LifeStyle Properties Inc	528	1,30
3 Honeywell International Inc	571	1,41	5 Equity Residential	378	0,93
Ernährung – 1,47 % (29. Februar 2024: 1,50 %)			8 Gaming and Leisure Properties Inc	411	1,02
7 McCormick & Co Inc/MD	595	1,47	9 Global Medical REIT Inc	78	0,19
Gesundheit – Dienstleistungen – 0,45 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			7 Lineage Inc	410	1,01
– UnitedHealth Group Inc	180	0,45	1 Prologis Inc	186	0,46
Bauunternehmen – 1,12 % (29. Februar 2024: 0,00 %)				4.118	10,18
4 Lennar Corp	451	1,12	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 4.122 \$)		
Versicherung – 1,30 % (29. Februar 2024: 0,44 %)				38.854	96,09
6 MetLife Inc	526	1,30	Devisenterminkontrakte – 0,01 % (29. Februar 2024: 0,01 %)		
Internet – 2,31 % (29. Februar 2024: 0,79 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4	0,01
2 Alphabet Inc 'A'	398	0,98	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
1 Meta Platforms Inc 'A'	537	1,33		38.858	96,10
	935	2,31	Devisenterminkontrakte – -0,02 % (29. Februar 2024: -0,01 %)		
Investmentgesellschaften – 1,94 % (29. Februar 2024: 1,58 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-10	-0,02
34 Ares Capital Corp	786	1,94	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Maschinen – Diversifiziert – 1,01 % (29. Februar 2024: 1,37 %)				-10	-0,02
4 Otis Worldwide Corp	410	1,01	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Pharma – 8,66 % (29. Februar 2024: 8,17 %)				38.848	96,08
3 AbbVie Inc	643	1,59	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
– Eli Lilly & Co	395	0,98		1.588	3,92
4 Johnson & Johnson	694	1,71	Gesamtneuvermögen		
1 McKesson Corp	512	1,27		40.436 \$	100,00
6 Merck & Co Inc	586	1,45			
16 Roche Holding AG ADR	671	1,66			
	3.501	8,66			
Pipelines – 15,72 % (29. Februar 2024: 11,77 %)					
3 Cheniere Energy Inc	576	1,42			
10 Enbridge Inc	441	1,09			
35 Kinder Morgan Inc	938	2,32			
13 ONEOK Inc	1.261	3,12			
58 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	1.253	3,10			
32 Williams Cos Inc/The	1.889	4,67			
	6.358	15,72			
Private Equity – 2,30 % (29. Februar 2024: 4,35 %)					
6 Blackstone Inc	930	2,30			
Halbleiter – 7,49 % (29. Februar 2024: 7,56 %)					
1 ASML Holding NV	484	1,20			
7 Broadcom Inc	1.370	3,39			
2 NXP Semiconductors NV	527	1,30			
4 QUALCOMM Inc	648	1,60			
	3.029	7,49			

– 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 %.

Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,71
Derivative Finanzinstrumente	0,01
Sonstige Vermögenswerte	4,28
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	23	Verkauf	AUD	36	\$	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	17	Verkauf	EUR	17		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	25	Verkauf	SGD	33		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	18	Verkauf	SGD	23		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	37	Verkauf	USD	29		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	453	Verkauf	USD	335		1
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	611	Verkauf	USD	631		3
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH	389	Verkauf	USD	53		–
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD	1.201	Verkauf	USD	755		-10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 3 \$)								\$	4
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -3 \$)									-10
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)								\$	-6

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 95,61 % (29. Februar 2024: 96,71 %)		
Bekleidung – 0,43 % (29. Februar 2024: 1,44 %)		
50 NIKE Inc	3.963	0,43
Banken – 7,30 % (29. Februar 2024: 5,73 %)		
392 Bank of America Corp	18.094	1,96
111 JPMorgan Chase & Co	29.392	3,19
149 Morgan Stanley	19.784	2,15
	67.270	7,30
Biotechnologie – 2,51 % (29. Februar 2024: 2,35 %)		
9 Argenx SE ADR	5.504	0,60
81 BioMarin Pharmaceutical Inc	5.780	0,63
104 Gilead Sciences Inc	11.834	1,28
	23.118	2,51
Baumaterialien – 3,80 % (29. Februar 2024: 4,17 %)		
34 Trane Technologies Plc	12.176	1,32
149 Trex Co Inc	9.198	1,00
55 Vulcan Materials Co	13.606	1,48
	34.980	3,80
Chemie – 1,35 % (29. Februar 2024: 1,89 %)		
46 Ecolab Inc	12.402	1,35
Gewerbliche Dienstleistungen – 1,11 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
16 United Rentals Inc	10.214	1,11
Computer – 8,25 % (29. Februar 2024: 7,40 %)		
53 Accenture Plc 'A'	18.366	1,99
221 Apple Inc	53.518	5,81
40 Dell Technologies Inc	4.089	0,45
	75.973	8,25
Kosmetik u. Körperpflege – 3,38 % (29. Februar 2024: 3,51 %)		
173 Colgate-Palmolive Co	15.730	1,71
89 Procter & Gamble Co/The	15.439	1,67
	31.169	3,38
Distribution u. Großhandel – 0,96 % (29. Februar 2024: 0,99 %)		
211 LKQ Corp	8.895	0,96
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,18 % (29. Februar 2024: 3,74 %)		
16 Blackrock Inc	15.449	1,68
64 Visa Inc 'A'	23.032	2,50
	38.481	4,18
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,38 % (29. Februar 2024: 3,54 %)		
43 Eaton Corp Plc	12.696	1,38
Energie – Alternative Quellen – 0,37 % (29. Februar 2024: 1,55 %)		
60 Enphase Energy Inc	3.454	0,37
Umweltkontrolle – 1,96 % (29. Februar 2024: 1,58 %)		
76 Republic Services Inc 'A'	18.088	1,96
Hand-/Maschinenwerkzeuge – 1,35 % (29. Februar 2024: 1,95 %)		
96 Regal Rexnord Corp	12.428	1,35
Gesundheit – Produkte – 2,59 % (29. Februar 2024: 5,00 %)		
116 Cooper Cos Inc/The	10.517	1,14
64 Danaher Corp	13.316	1,45
	23.833	2,59
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,89 % (29. Februar 2024: 2,12 %)		
37 UnitedHealth Group Inc	17.377	1,89
Versicherung – 4,45 % (29. Februar 2024: 3,86 %)		
77 Hartford Insurance Group Inc/The	9.056	0,98
137 MetLife Inc	11.785	1,28
78 Travelers Cos Inc/The	20.198	2,19
	41.039	4,45
Internet – 11,01 % (29. Februar 2024: 5,23 %)		
148 Alphabet Inc 'A'	25.240	2,74
207 Amazon.com Inc	43.968	4,77
4 Booking Holdings Inc	18.529	2,01
253 Chewy Inc 'A'	9.417	1,02
27 Reddit Inc	4.337	0,47
	101.491	11,01
Maschinen – Diversifiziert – 1,03 % (29. Februar 2024: 0,67 %)		
20 Deere & Co	9.469	1,03
Medien – 1,92 % (29. Februar 2024: 1,74 %)		
155 Walt Disney Co/The	17.684	1,92
Verpackung u. Behälter – 0,46 % (29. Februar 2024: 1,60 %)		
80 Ball Corp	4.211	0,46

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Pharma – 6,52 % (29. Februar 2024: 5,60 %)		
240 CVS Health Corp	15.766	1,71
93 Johnson & Johnson	15.394	1,67
23 McKesson Corp	14.658	1,59
157 Novo Nordisk A.S ADR	14.236	1,55
	60.054	6,52
Einzelhandel – 5,09 % (29. Februar 2024: 7,62 %)		
16 Costco Wholesale Corp	17.084	1,85
56 Home Depot Inc/The	22.043	2,39
40 Williams-Sonoma Inc	7.789	0,85
	46.916	5,09
Halbleiter – 9,42 % (29. Februar 2024: 5,97 %)		
18 ASML Holding NV	12.413	1,35
146 Broadcom Inc	29.137	3,16
168 Lam Research Corp	12.866	1,40
259 NVIDIA Corp	32.366	3,51
	86.782	9,42
Software – 11,23 % (29. Februar 2024: 12,28 %)		
11 Adobe Inc	4.647	0,50
153 Microsoft Corp	60.667	6,58
42 Salesforce Inc	12.353	1,34
16 ServiceNow Inc	14.553	1,58
25 Synopsys Inc	11.291	1,23
	103.511	11,23
Wasser – 1,67 % (29. Februar 2024: 1,44 %)		
113 American Water Works Co Inc	15.386	1,67
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 724.480 \$)		
	880.884	95,61
Real Estate Investment Trusts – 3,39 % (29. Februar 2024: 3,45 %)		
REITS – 3,39 % (29. Februar 2024: 3,45 %)		
17 Equinix Inc	15.378	1,67
128 Prologis Inc	15.842	1,72
	31.220	3,39
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 27.252 \$)		
	31.220	3,39
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 751.732 \$)		
	912.104	99,00
Devisenterminkontrakte – 0,10 % (29. Februar 2024: 0,03 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	926	0,10
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	913.030	99,10
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-3	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-3	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	913.027	99,10
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	8.329	0,90
Gesamtvermögen		
	921.356 \$	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:

ADR – American Depositary Receipt

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,62
Derivative Finanzinstrumente	0,10
Sonstige Vermögenswerte	1,28
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung/ von Kontrakten (in Tsd.)
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)				
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	1.562	Verkauf	EUR	1.488	\$ 18
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	173	Verkauf	EUR	167	-1
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	2.226	Verkauf	GBP	1.761	11
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	137	Verkauf	GBP	110	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	33	Verkauf	USD	35	–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	23.445	Verkauf	USD	24.220	117
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	224	Verkauf	USD	283	-2
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	40.993	Verkauf	USD	50.782	780
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 370 \$)								\$ 926
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -16 \$)								-3
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 354 \$)								\$ 923

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 98,59 % (29. Februar 2024: 99,19 %)		
Belgien – 0,67 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
EUR 1 UCB SA	184	0,67
Brasilien – 0,87 % (29. Februar 2024: 1,41 %)		
– MercadoLibre Inc	237	0,87
Kanada – 3,90 % (29. Februar 2024: 3,60 %)		
CAD – Constellation Software Inc/Canada	426	1,56
CAD 3 Dollarama Inc	306	1,12
3 Shopify Inc 'A'	334	1,22
	1.066	3,90
China – 3,25 % (29. Februar 2024: 0,36 %)		
HKD 7 BYD Co Ltd	321	1,18
HKD 246 Lenovo Group Ltd	369	1,35
6 Zai Lab Ltd ADR	197	0,72
	887	3,25
Dänemark – 1,75 % (29. Februar 2024: 1,95 %)		
DKK 4 Novo Nordisk A/S	375	1,37
DKK 1 Zealand Pharma A/S	104	0,38
	479	1,75
Frankreich – 3,46 % (29. Februar 2024: 2,03 %)		
EUR 6 Danone SA	418	1,53
– Hermes International SCA	237	0,87
EUR – L'Oreal SA	113	0,41
EUR 2 Publicis Groupe SA	178	0,65
	946	3,46
Deutschland – 1,46 % (29. Februar 2024: 3,08 %)		
EUR 1 SAP SE	398	1,46
Indien – 1,46 % (29. Februar 2024: 1,08 %)		
6 HDFC Bank Ltd ADR	399	1,46
Israel – 1,01 % (29. Februar 2024: 1,02 %)		
1 Check Point Software Technologies Ltd	276	1,01
Italien – 2,62 % (29. Februar 2024: 0,86 %)		
EUR 1 Ferrari NV	237	0,87
EUR 70 Intesa Sanpaolo SpA	343	1,25
EUR 2 Prysmian SpA	137	0,50
	717	2,62
Japan – 3,88 % (29. Februar 2024: 5,19 %)		
JPY 11 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	144	0,53
JPY 10 Sony Group Corp	254	0,93
JPY 14 Terumo Corp	256	0,93
JPY 7 Tokio Marine Holdings Inc	258	0,95
JPY 1 Tokyo Electron Ltd	148	0,54
	1.060	3,88
Niederlande – 1,58 % (29. Februar 2024: 3,14 %)		
EUR – Adyen NV, 144A	170	0,62
– Argenx SE ADR	261	0,96
	431	1,58
Singapur – 1,76 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
4 Sea Ltd ADR	482	1,76
Südkorea – 0,90 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
KRW 2 SK Hynix Inc	247	0,90
Spanien – 1,80 % (29. Februar 2024: 0,72 %)		
EUR 27 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	356	1,30
EUR 3 Industria de Diseño Textil SA	135	0,50
	491	1,80
Schweiz – 0,69 % (29. Februar 2024: 1,02 %)		
CHF 4 ABB Ltd	190	0,69
Taiwan – 1,88 % (29. Februar 2024: 2,09 %)		
TWD 17 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	513	1,88
Vereinigtes Königreich – 5,00 % (29. Februar 2024: 1,96 %)		
GBP 348 Lloyds Banking Group Plc	323	1,18
GBP 2 London Stock Exchange Group Plc	315	1,16
GBP 10 RELX Plc	462	1,69
GBP 5 Unilever Plc	265	0,97
	1.365	5,00
USA – 60,65 % (29. Februar 2024: 66,93 %)		
1 Adobe Inc	306	1,12
1 Airbnb Inc	138	0,50
4 Alphabet Inc 'A'	716	2,62

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
5 Amazon.com Inc	1.100	4,03
5 Apple Inc	1.174	4,29
6 Bank of America Corp	268	0,98
3 Broadcom Inc	505	1,85
6 Chewy Inc 'A'	224	0,82
1 Chubb Ltd	285	1,04
3 Coca-Cola Co/The	210	0,77
– Costco Wholesale Corp	386	1,41
3 CRH Plc	257	0,94
2 DocuSign Inc „A“	176	0,64
– Eli Lilly & Co	330	1,21
1 Inspire Medical Systems Inc	127	0,46
4 Intercontinental Exchange Inc	643	2,35
– Intuit Inc	280	1,03
1 Intuitive Surgical Inc	375	1,37
1 JPMorgan Chase & Co	271	0,99
3 KKR & Co Inc	399	1,46
1 Marsh & McLennan Cos Inc	291	1,07
1 Meta Platforms Inc 'A'	734	2,68
3 Microsoft Corp	1.088	3,98
2 MoonLake Immunotherapeutics 'A'	70	0,25
– Netflix Inc	186	0,68
2 NIKE Inc	191	0,70
9 NVIDIA Corp	1.183	4,33
2 Old Dominion Freight Line Inc	291	1,07
1 Reddit Inc	218	0,80
2 Republic Services Inc 'A'	431	1,58
3 ROBLOX Corp	193	0,71
– S&P Global Inc	137	0,50
1 Spotify Technology SA	327	1,20
2 Starbucks Corp	224	0,82
– Thermo Fisher Scientific Inc	251	0,92
2 TJX Cos Inc/The	206	0,75
3 T-Mobile US Inc	682	2,50
1 Trane Technologies Plc	298	1,09
2 Union Pacific Corp	555	2,03
– Vertex Pharmaceuticals Inc	187	0,68
1 Visa Inc 'A'	298	1,09
3 Walt Disney Co/The	365	1,34
	16.576	60,65
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 23.527 \$)		
	26.944	98,59
Real Estate Investment Trusts – 0,94 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
USA – 0,94 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
– Equinix Inc	257	0,94
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 238 \$)		
	257	0,94
Optionsscheine – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Kanada – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
CAD – Constellation Software Inc/Canada ∞	–	–
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten – \$)		
	–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	27.201	99,53
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	27.201	99,53
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	128	0,47
Gesamt Nettovermögen		
	27.329 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 170.000 \$ und machten 0,62 % des Nettovermögens aus.

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

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
CAD	– Kanadischer Dollar
CHF	– Schweizer Franken
DKK	– Dänische Krone
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HKD	– Hongkong-Dollar
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Won
TWD	– Taiwanesischer Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,28
Sonstige Vermögenswerte	0,72
Gesamtvermögen	100,00

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 97,82 % (29. Februar 2024: 91,66 %)		
Australien – 1,96 % (29. Februar 2024: 2,05 %)		
AUD 3.262 APA Group	14.415	1,96
Brasilien – 1,78 % (29. Februar 2024: 4,77 %)		
BRL 2.092 Centrais Eletricas Brasileiras SA	13.090	1,78
Kanada – 14,25 % (29. Februar 2024: 4,89 %)		
CAD 206 Canadian National Railway Co	20.150	2,75
CAD 869 Emera Inc	33.504	4,56
CAD 488 Pembina Pipeline Corp	18.285	2,49
CAD 758 TC Energy Corp	32.703	4,45
	104.642	14,25
Frankreich – 8,14 % (29. Februar 2024: 7,05 %)		
152 Aeroports de Paris SA	14.992	2,04
1.413 Getlink SE	22.555	3,07
201 Vinci SA	22.225	3,03
	59.772	8,14
Deutschland – 6,65 % (29. Februar 2024: 4,88 %)		
1.833 E.ON SE	22.521	3,07
474 Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	26.257	3,58
	48.778	6,65
Italien – 6,04 % (29. Februar 2024: 5,29 %)		
3.393 Enel SpA	23.946	3,26
2.527 Terna – Rete Elettrica Nazionale	20.363	2,78
	44.309	6,04
Spanien – 6,09 % (29. Februar 2024: 1,84 %)		
88 Aena SME SA, 144A	18.828	2,57
1.499 Redeia Corp SA	25.859	3,52
	44.687	6,09
Vereinigtes Königreich – 7,30 % (29. Februar 2024: 8,41 %)		
GBP 1.088 Severn Trent Plc	33.127	4,51
GBP 1.718 United Utilities Group Plc	20.486	2,79
	53.613	7,30
USA – 45,61 % (29. Februar 2024: 42,52 %)		
USD 498 CenterPoint Energy Inc	16.495	2,25
USD 90 Cheniere Energy Inc	19.772	2,69
USD 68 Constellation Energy Corp	16.325	2,22
USD 701 CSX Corp	21.628	2,95
USD 340 Dominion Energy Inc	18.560	2,53
USD 174 DTE Energy Co	22.467	3,06
USD 472 Entergy Corp	39.670	5,40
636 Ferrovia SE	27.240	3,71
USD 470 NextEra Energy Inc	31.796	4,33
USD 472 OGE Energy Corp	21.043	2,87
USD 199 ONEOK Inc	19.273	2,63
USD 1.088 PG&E Corp	17.132	2,33
USD 92 Union Pacific Corp	21.906	2,98
USD 296 WEC Energy Group Inc	30.489	4,15
USD 198 Williams Cos Inc/The	11.081	1,51
	334.877	45,61
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 641.864 €)		97,82
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 641.864 €)		97,82
Devisenterminkontrakte – 0,02 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	158	0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		97,84
Devisenterminkontrakte – -0,16 % (29. Februar 2024: -0,11 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.213	-0,16
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		-0,16
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		97,68
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		2,32
Gesamt Nettovermögen		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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 18.828.000 € und machten 2,57 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:	
AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
GBP	– Britisches Pfund Sterling
USD	– US-Dollar

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,37
Derivative Finanzinstrumente	0,02
Sonstige Vermögenswerte	2,61
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 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
5. März 2025	BNY	Kauf	EUR 916	Verkauf	BRL 5.496	€ 17	
5. März 2025	BNY	Kauf	BRL 66	Verkauf	EUR 11	–	
5. März 2025	BNY	Kauf	BRL 5.430	Verkauf	EUR 882	6	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 109	Verkauf	AUD 182	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 1.173	Verkauf	CNH 8.908	-5	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 971	Verkauf	CNH 7.315	4	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 90.110	Verkauf	EUR 87.232	-422	
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 6.350	Verkauf	EUR 4.545	-15	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD 4.750	Verkauf	EUR 4.541	39	
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD 3.309	Verkauf	EUR 2.012	-35	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP 66	Verkauf	EUR 79	1	
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD 136	Verkauf	EUR 95	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH 97.566	Verkauf	EUR 12.942	-47	
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH 1.360	Verkauf	EUR 179	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 13	Verkauf	SGD 20	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 129	Verkauf	SGD 180	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 493	Verkauf	USD 510	1	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR 894	Verkauf	USD 939	-9	
26. März 2025	BNY	Kauf	EUR 271	Verkauf	AUD 445	5	
26. März 2025	BNY	Kauf	GBP 54	Verkauf	AUD 107	2	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 1.430	Verkauf	AUD 1.578	10	
26. März 2025	BNY	Kauf	GBP 48	Verkauf	BRL 346	2	
26. März 2025	BNY	Kauf	EUR 252	Verkauf	BRL 1.512	7	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 1.265	Verkauf	BRL 5.117	11	
26. März 2025	BNY	Kauf	GBP 371	Verkauf	CAD 665	7	
26. März 2025	BNY	Kauf	BRL 191	Verkauf	CAD 47	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	EUR 1.955	Verkauf	CAD 2.906	19	
26. März 2025	BNY	Kauf	USD 766	Verkauf	CAD 1.085	14	
26. März 2025	BNY	Kauf	BRL 151	Verkauf	EUR 24	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	AUD 17	Verkauf	EUR 10	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	GBP 934	Verkauf	EUR 1.123	5	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 23.233	Verkauf	EUR 15.624	-145	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 270	Verkauf	EUR 180	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	USD 671	Verkauf	EUR 637	8	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 4.982	Verkauf	GBP 2.781	-49	
26. März 2025	BNY	Kauf	BRL 14	Verkauf	GBP 2	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	EUR 994	Verkauf	GBP 825	-5	
26. März 2025	BNY	Kauf	USD 55	Verkauf	GBP 43	–	
26. März 2025	BNY	Kauf	EUR 5.902	Verkauf	USD 6.192	-61	
26. März 2025	BNY	Kauf	GBP 1.121	Verkauf	USD 1.418	-7	
26. März 2025	BNY	Kauf	CAD 29.691	Verkauf	USD 20.955	-395	
02. Apr. 2025	BNY	Kauf	BRL 5.617	Verkauf	EUR 929	-18	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 26 €)						€ 158	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -891 €)						-1,213	
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -865 €)						€ -1,055	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 92,50 % (29. Februar 2024: 87,73 %)			
Australien – 3,84 % (29. Februar 2024: 4,36 %)			
AUD	1.539 APA Group	7.054	2,46
AUD	1.258 Atlas Arteria Ltd	3.971	1,38
		11.025	3,84
Brasilien – 1,57 % (29. Februar 2024: 2,81 %)			
BRL	758 CPFL Energia SA	4.504	1,57
Kanada – 16,46 % (29. Februar 2024: 6,85 %)			
CAD	299 Emera Inc	11.959	4,16
CAD	219 Enbridge Inc	9.377	3,27
CAD	216 Pembina Pipeline Corp	8.416	2,93
CAD	264 South Bow Corp	7.029	2,45
CAD	234 TC Energy Corp	10.476	3,65
		47.257	16,46
Frankreich – 4,51 % (29. Februar 2024: 2,18 %)			
EUR	26 Aeroports de Paris SA	2.676	0,93
EUR	89 Vinci SA	10.273	3,58
		12.949	4,51
Deutschland – 5,23 % (29. Februar 2024: 1,50 %)			
EUR	819 E.ON SE	10.432	3,64
EUR	80 Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	4.571	1,59
		15.003	5,23
Italien – 7,65 % (29. Februar 2024: 6,44 %)			
EUR	1.376 Enel SpA	10.079	3,51
EUR	515 Italgas SpA	3.310	1,15
EUR	1.782 Snam SpA	8.584	2,99
		21.973	7,65
Portugal – 2,12 % (29. Februar 2024: 4,37 %)			
EUR	1.892 EDP SA	6.093	2,12
Spanien – 7,16 % (29. Februar 2024: 5,85 %)			
EUR	36 Aena SME SA, 144A	8.063	2,81
EUR	698 Redeia Corp SA	12.490	4,35
		20.553	7,16
Vereinigtes Königreich – 10,66 % (29. Februar 2024: 10,11 %)			
GBP	598 National Grid Plc	7.346	2,56
GBP	1.177 Pennon Group Plc	6.223	2,17
GBP	401 Severn Trent Plc	12.650	4,40
GBP	228 SSE Plc	4.395	1,53
		30.614	10,66
USA – 33,30 % (29. Februar 2024: 38,06 %)			
	263 Brookfield Renewable Corporation	7.315	2,55
	23 Constellation Energy Corp	5.772	2,01
	181 Dominion Energy Inc	10.267	3,57
	179 Entergy Corp	15.590	5,43
	184 NextEra Energy Inc	12.889	4,49
	229 OGE Energy Corp	10.615	3,70
	80 ONEOK Inc	8.046	2,80
	41 Union Pacific Corp	10.054	3,50

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
	87 WEC Energy Group Inc	9.298	3,24
	99 Williams Cos Inc/The	5.780	2,01
		95.626	33,30
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 252.921 \$)		265.597	92,50
Vorzugsaktien – 2,19 % (29. Februar 2024: 2,48 %)			
Brasilien – 2,19 % (29. Februar 2024: 2,48 %)			
BRL	881 Centrais Eletricas Brasileiras SA	6.298	2,19
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 6.729 \$)		6.298	2,19
Real Estate Investment Trusts – 3,38 % (29. Februar 2024: 8,11 %)			
USA – 3,38 % (29. Februar 2024: 8,11 %)			
	103 Crown Castle Inc	9.717	3,38
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 12.306 \$)		9.717	3,38
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 271.956 \$)		281.612	98,07
Devisenterminkontrakte – 0,07 % (29. Februar 2024: 0,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		198	0,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		281.810	98,14
Devisenterminkontrakte – -0,03 % (29. Februar 2024: 0,04 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		-69	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		-69	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		281.741	98,11
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		5.408	1,89
Gesamtnettovermögen		287.149 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.063.000 \$ und machten 2,81 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,18
Derivative Finanzinstrumente	0,07
Sonstige Vermögenswerte	2,75
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)				
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	26	Verkauf	CNH	190	\$	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	116	Verkauf	EUR	112		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	33	Verkauf	GBP	26		–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	735	Verkauf	SGD	983		7
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	956	Verkauf	SGD	1291		-2
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	158	Verkauf	USD	118		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	58.115	Verkauf	USD	42.965		63
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	32	Verkauf	USD	42		–
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	4.876	Verkauf	USD	6040		93
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	29	Verkauf	USD	31		–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	6.786	Verkauf	USD	7.010		34
14. März 2025	BNY	Kauf	CNH	8.595	Verkauf	USD	1178		1
14. März 2025	BNY	Kauf	AUD	8.314	Verkauf	USD	5.226		-67
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 255 \$)								\$	198
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -124 \$)									-69
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 131 \$)								\$	129

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 91,31 % (29. Februar 2024: 91,18 %)			
Kanada – 1,94 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
CAD	3 Teck Resources Ltd	130	1,94
Frankreich – 8,27 % (29. Februar 2024: 11,94 %)			
EUR	4 Bureau Veritas SA	124	1,86
EUR	2 Nexans SA	198	2,95
EUR	4 TotalEnergies SE	232	3,46
		554	8,27
Deutschland – 8,12 % (29. Februar 2024: 4,87 %)			
EUR	1 Gerresheimer AG	98	1,46
EUR	1 Siemens AG	228	3,41
EUR	4 Siemens Energy AG	218	3,25
		544	8,12
Griechenland – 2,23 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	31 Piraeus Financial Holdings SA ADR	149	2,23
Indonesien – 0,86 % (29. Februar 2024: 1,95 %)			
IDR	282 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	58	0,86
Japan – 3,36 % (29. Februar 2024: 5,26 %)			
JPY	9 Hitachi Ltd	225	3,36
Spanien – 4,48 % (29. Februar 2024: 3,88 %)			
EUR	23 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	300	4,48
Vereinigtes Königreich – 15,06 % (29. Februar 2024: 12,29 %)			
GBP	1 AstraZeneca Plc	220	3,28
GBP	8 Compass Group Plc	271	4,04
GBP	16 National Grid Plc	202	3,02
GBP	4 Unilever Plc	214	3,20
GBP	8 United Utilities Group Plc	102	1,52
		1.009	15,06
USA – 46,99 % (29. Februar 2024: 49,19 %)			
	3 American International Group Inc	214	3,20
	3 Charles Schwab Corp/The	265	3,96
	17 CNH Industrial NV	217	3,24
	11 Coty Inc	64	0,96
	3 CVS Health Corp	180	2,69
	5 EQT Corp	217	3,24
	1 Fiserv Inc	149	2,23
	2 Fortune Brands Innovations Inc	112	1,67
	1 ICON Plc	149	2,23
	1 Johnson & Johnson	185	2,75
	2 Johnson Controls International plc	152	2,27
	– Meta Platforms Inc 'A'	140	2,08
	3 NextEra Energy Inc	186	2,78

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	EUR	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	GBP	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	SGD	17	Verkauf	USD	13	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	1	
14. März 2025	BNY	Kauf	GBP	11	Verkauf	USD	13	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	–	
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	12	Verkauf	USD	13	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)								–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)								–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)								–

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
	1 Oracle Corp	122	1,82
	3 PayPal Holdings Inc	243	3,63
	2 Uber Technologies Inc	171	2,55
	1 Vertiv Holdings Co 'A'	66	0,98
	4 Wells Fargo & Co	316	4,71
		3.148	46,99
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.930 \$)		6.117	91,31
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 4.930 \$)		6.117	91,31
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		6.117	91,31
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		6.117	91,31
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		582	8,69
Gesamtvermögen		6.699 \$	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
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,61
Sonstige Vermögenswerte	9,39
Gesamtvermögen	100,00

[^] 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 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,37 % (29. Februar 2024: 2,52 %)		
33.129 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	33.129	3,37
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 33.129 \$)	33.129	3,37
Stammaktien – 96,66 % (29. Februar 2024: 96,65 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 3,82 % (29. Februar 2024: 4,10 %)		
114 AAR Corp	7.431	0,75
349 Astronics Corp	6.985	0,71
99 Ducommun Inc	5.822	0,59
213 Kratos Defense & Security Solutions Inc	5.628	0,57
203 Leonardo DRS Inc	6.194	0,63
126 Mercury Systems Inc	5.586	0,57
	37.646	3,82
Bekleidung – 1,16 % (29. Februar 2024: 1,02 %)		
121 Capri Holdings Ltd	2.655	0,27
371 Lakeland Industries Inc	8.728	0,89
	11.383	1,16
Automobilhersteller – 0,40 % (29. Februar 2024: 0,71 %)		
339 Wabash National Corp	3.964	0,40
Autoteile u. Ausstattung – 1,75 % (29. Februar 2024: 3,07 %)		
863 Commercial Vehicle Group Inc	1.800	0,18
88 Fox Factory Holding Corp	2.449	0,25
690 Garrett Motion Inc	6.665	0,68
– Gentherm Inc	6	–
505 indie Semiconductor Inc	1.522	0,15
354 Shyft Group Inc/The	3.553	0,36
148 Titan International Inc	1.264	0,13
	17.259	1,75
Banken – 4,18 % (29. Februar 2024: 2,27 %)		
183 BankUnited Inc	6.860	0,70
194 BayCom Corp	5.338	0,54
238 Business First Bancshares Inc	6.320	0,64
77 Customers Bancorp Inc	4.134	0,42
144 Dime Community Bancshares Inc	4.462	0,45
481 First Foundation Inc	2.453	0,25
113 Hilltop Holdings Inc	3.615	0,37
158 Seacoast Banking Corp of Florida	4.456	0,45
41 Walker & Dunlop Inc	3.513	0,36
	41.151	4,18
Biotechnologie – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,43 %)		
381 NeoGenomics Inc	3.805	0,38
553 Tela Bio Inc	1.358	0,14
	5.163	0,52
Baumaterialien – 0,95 % (29. Februar 2024: 2,84 %)		
220 Aspen Aerogels Inc	1.676	0,17
56 Gibraltar Industries Inc	3.653	0,37
38 Modine Manufacturing Co	3.177	0,33
650 SmartRent Inc	803	0,08
	9.309	0,95
Chemie – 1,05 % (29. Februar 2024: 1,38 %)		
106 Ingevity Corp	5.062	0,51
492 Mativ Holdings Inc	3.325	0,34
250 Tronox Holdings Plc	1.940	0,20
	10.327	1,05
Gewerbliche Dienstleistungen – 4,97 % (29. Februar 2024: 5,96 %)		
267 Acacia Research Corp	1.123	0,11
26 American Public Education Inc	542	0,06
627 Arlo Technologies Inc	9.014	0,92
83 GDI Integrated Facility Services Inc	1.949	0,20
700 Healthcare Services Group Inc	7.353	0,75
21 Herc Holdings Inc	3.076	0,31
158 Kelly Services Inc 'A'	2.128	0,22
59 Korn Ferry	3.884	0,39
177 LiveRamp Holdings Inc	5.301	0,54
326 Repay Holdings Corp 'A'	2.353	0,24
545 Resources Connection Inc	3.974	0,40
617 TrueBlue Inc	3.877	0,39
454 Udemy Inc	4.376	0,44
	48.950	4,97
Computer – 4,55 % (29. Februar 2024: 3,32 %)		
639 Conduent Inc	2.271	0,23
166 Endava Plc ADR	3.972	0,40
8 Globant SA	1.260	0,13
276 Grid Dynamics Holdings Inc	5.192	0,53

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
202 Kyndryl Holdings Inc	7.707	0,78
145 NCR Atleos Corp	4.126	0,42
223 Stratascys Ltd	2.356	0,24
366 TaskUS Inc 'A'	5.178	0,53
116 V2X Inc	5.440	0,55
128 WNS Holdings Ltd	7.276	0,74
	44.778	4,55
Distribution u. Großhandel – 2,53 % (29. Februar 2024: 3,49 %)		
448 MRC Global Inc	5.452	0,55
290 Resideo Technologies Inc	5.579	0,57
86 Titan Machinery Inc	1.475	0,15
64 VSE Corp	7.638	0,78
26 WESCO International Inc	4.714	0,48
	24.858	2,53
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,73 % (29. Februar 2024: 2,70 %)		
124 Air Lease Corp 'A'	5.945	0,61
115 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	4.850	0,49
827 Canaccord Genuity Group Inc	4.689	0,48
136 Marex Group Plc	5.004	0,51
35 Moelis & Co 'A'	2.493	0,25
278 Perella Weinberg Partners 'A'	6.417	0,65
114 Victory Capital Holdings Inc 'A'	7.321	0,74
	36.719	3,73
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,46 % (29. Februar 2024: 1,51 %)		
188 American Superconductor Corp	4.261	0,44
130 Insteel Industries Inc	3.652	0,37
699 nLight Inc	6.417	0,65
	14.330	1,46
Elektronik – 4,61 % (29. Februar 2024: 5,42 %)		
28 Advanced Energy Industries Inc	3.280	0,33
250 Applied Optoelectronics Inc	5.471	0,56
29 Coherent Corp	2.200	0,22
738 Comtech Telecommunications Corp	1.259	0,13
122 CTS Corp	5.443	0,55
257 FARO Technologies Inc	8.206	0,84
682 Identiv Inc	2.481	0,25
447 Knowles Corp	7.410	0,75
2.384 Kopin Corp	3.278	0,33
381 Stoneridge Inc	2.144	0,22
248 Vishay Intertechnology Inc	4.254	0,43
	45.426	4,61
Energie – Alternative Quellen – 0,12 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
386 Shoals Technologies Group Inc 'A'	1.168	0,12
Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 3,13 % (29. Februar 2024: 3,82 %)		
486 Concrete Pumping Holdings Inc	3.179	0,32
63 Construction Partners Inc 'A'	4.562	0,46
28 Limbach Holdings Inc	2.354	0,24
685 Mistras Group Inc	6.736	0,69
969 Orion Group Holdings Inc	6.896	0,70
98 Primoris Services Corp	7.041	0,72
	30.768	3,13
Unterhaltung – 1,50 % (29. Februar 2024: 0,34 %)		
211 IMAX Corp	5.387	0,55
528 Lions Gate Entertainment Corp	5.269	0,53
104 Pursuit Attractions and Hospitality Inc	4.142	0,42
	14.798	1,50
Umweltkontrolle – 1,05 % (29. Februar 2024: 0,77 %)		
273 CECO Environmental Corp	6.793	0,69
183 Montrose Environmental Group Inc	3.563	0,36
	10.356	1,05
Ernährung – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,67 %)		
814 SunOpta Inc	5.094	0,52
Hand-/Maschinenwerkzeuge – 0,68 % (29. Februar 2024: 0,46 %)		
551 Luxfer Holdings Plc	6.718	0,68
Gesundheit – Produkte – 3,71 % (29. Februar 2024: 3,11 %)		
492 AngioDynamics Inc	4.569	0,47
753 Apyx Medical Corp	1.100	0,11
240 Artivion Inc	6.103	0,62
134 Azenta Inc	5.828	0,59
412 Bioventus Inc	4.174	0,42
124 Enovis Corp	4.778	0,49
298 MiMedx Group Inc	2.502	0,25
206 Tactile Systems Technology Inc	2.936	0,30
351 Varex Imaging Corp	4.522	0,46
	36.512	3,71

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – (Fortsetzung)			Fertigung diverse – 1,27 % (29. Februar 2024: 1,11 %)		
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,56 % (29. Februar 2024: 1,42 %)			EUR 169 AMG Critical Materials NV	2.914	0,30
121 Astrana Health Inc	3.072	0,31	13 Enpro Inc	2.298	0,23
642 Community Health Systems Inc	1.931	0,19	8 Fabrinet	1.510	0,15
118 Concentra Group Holdings Parent Inc	2.670	0,27	185 Trinity Industries Inc	5.744	0,59
923 Quipt Home Medical Corp	2.431	0,25		1.2466	1,27
49 RadNet Inc	2.726	0,28			
139 Select Medical Holdings Corp	2.536	0,26			
	15.366	1,56	Öl u. Gas – 3,16 % (29. Februar 2024: 2,08 %)		
Bauunternehmen – 3,40 % (29. Februar 2024: 3,18 %)			1.351 Baytex Energy Corp	3.046	0,31
122 Beazer Homes USA Inc	2.719	0,28	317 Comstock Resources Inc	5.698	0,58
9 Cavco Industries Inc	4.866	0,49	913 Kosmos Energy Ltd	2.561	0,26
40 Century Communities Inc	2.774	0,28	52 Matador Resources Co	2.699	0,28
79 Champion Homes Inc	8.059	0,82	119 Northern Oil & Gas Inc	3.738	0,38
26 MI Homes Inc	3.043	0,31	586 Patterson-UTI Energy Inc	4.864	0,49
90 Taylor Morrison Home Corp 'A'	5.530	0,56	397 SandRidge Energy Inc	4.648	0,47
22 Toll Brothers Inc	2.443	0,25	CAD 451 Vermilion Energy Inc	3.825	0,39
128 Tri Pointe Homes Inc	4.048	0,41		31.079	3,16
	33.482	3,40	Öl- u. Gasdienstleistungen – 6,03 % (29. Februar 2024: 3,71 %)		
Wohnungseinrichtungen – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,05 %)			140 Archrock Inc	3.787	0,38
109 Xperi Inc	925	0,09	164 Atlas Energy Solutions Inc	3.175	0,32
Haushaltswaren u. -artikel – 0,23 % (29. Februar 2024: 0,47 %)			294 DNOW Inc	4.696	0,48
30 Spectrum Brands Holdings Inc	2.299	0,23	153 Kodiak Gas Services Inc	6.590	0,67
Versicherung – 0,47 % (29. Februar 2024: 0,54 %)			190 Liberty Energy Inc 'A'	3.288	0,33
406 Abacus Life Inc	3.155	0,32	679 Mammoth Energy Services Inc	1.660	0,17
24 Brighthouse Financial Inc	1.440	0,15	370 Matrix Service Co	4.627	0,47
	4.595	0,47	657 NPK International Inc	4.006	0,41
Internet – 3,89 % (29. Februar 2024: 5,72 %)			456 ProPetro Holding Corp	3.845	0,39
228 Beyond Inc	1.453	0,15	350 Ranger Energy Services Inc	5.854	0,60
22 Cars.com Inc	292	0,03	710 Select Water Solutions Inc	8.620	0,88
152 Criteo SA ADR	5.915	0,60	236 Solaris Energy Infrastructure Inc 'A'	8.069	0,82
1.200 DHI Group Inc	2.953	0,30	297 TETRA Technologies Inc	1.124	0,11
203 EverQuote Inc	5.444	0,55		59.341	6,03
138 IAC Inc	6.364	0,65	Pharma – 1,39 % (29. Februar 2024: 0,98 %)		
532 LifeMD Inc	2.796	0,28	482 AdaptHealth Corp 'A'	5.478	0,56
302 Magnite Inc	4.759	0,48	87 Harrow Inc	2.443	0,25
507 OptimizeRx Corp	2.617	0,27	387 Organon & Co	5.761	0,58
293 QuinStreet Inc	5.738	0,58		13.682	1,39
	38.331	3,89	Private Equity – 0,47 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Eisen/Stahl – 1,85 % (29. Februar 2024: 2,30 %)			445 Bridge Investment Group Holdings Inc	4.675	0,47
127 ATI Inc	7.384	0,75	Immobilien – 0,40 % (29. Februar 2024: 0,09 %)		
24 Carpenter Technology Corp	4.975	0,51	409 Kennedy-Wilson Holdings Inc	3.970	0,40
120 Commercial Metals Co	5.826	0,59	Einzelhandel – 3,55 % (29. Februar 2024: 5,41 %)		
	18.185	1,85	112 Advance Auto Parts Inc	4.122	0,42
Beherbergung – 0,08 % (29. Februar 2024: 0,06 %)			199 Caleres Inc	3.221	0,33
280 Century Casinos Inc	740	0,08	10 Dillard's Inc	3.936	0,40
Maschinen – Bau u. Bergbau – 0,70 % (29. Februar 2024: 1,34 %)			192 J Jill Inc	4.546	0,46
6 Argan Inc	795	0,08	197 MarineMax Inc	4.993	0,51
59 BWX Technologies Inc	6.100	0,62	82 Movado Group Inc	1.585	0,16
	6.895	0,70	481 Noodles & Co 'A'	680	0,07
Maschinen – Diversifiziert – 2,01 % (29. Februar 2024: 1,99 %)			230 OneWater Marine Inc 'A'	3.812	0,39
CAD 100 Ag Growth International Inc	2.492	0,25	45 Patrick Industries Inc	4.091	0,42
39 Chart Industries Inc	7.410	0,75	613 Vera Bradley Inc	2.009	0,20
16 Eastman Kodak Co	114	0,01	71 Victoria's Secret & Co	1.906	0,19
264 Ichor Holdings Ltd	7.733	0,79		34.901	3,55
215 Intevac Inc	863	0,09	Sparen u. Kredite – 0,24 % (29. Februar 2024: 0,27 %)		
140 Twin Disc Inc	1.200	0,12	35 Axos Financial Inc	2.321	0,24
	19.812	2,01	Halbleiter – 5,25 % (29. Februar 2024: 5,78 %)		
Medien – 0,33 % (29. Februar 2024: 0,42 %)			151 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	4.572	0,47
190 Thryv Holdings Inc	3.277	0,33	178 Amkor Technology Inc	3.762	0,38
Metallherstellung u. -elemente – 2,32 % (29. Februar 2024: 2,06 %)			323 Amtech Systems Inc	1.599	0,16
168 Helios Technologies Inc	6.612	0,67	215 Cohu Inc	4.238	0,43
314 Janus International Group Inc	2.541	0,26	151 FormFactor Inc	5.037	0,51
304 Mayville Engineering Co Inc	4.532	0,46	427 inTEST Corp	3.576	0,36
295 Metallus Inc	4.254	0,43	68 IPG Photonics Corp	3.951	0,40
111 Northwest Pipe Co	4.876	0,50	124 Kulicke & Soffa Industries Inc	4.744	0,48
	22.815	2,32	9 Onto Innovation Inc	1.379	0,14
Bergbau – 1,36 % (29. Februar 2024: 1,31 %)			283 Penguin Solutions Inc	5.650	0,57
CAD 925 Capstone Copper Corp	5.103	0,52	202 Ultra Clean Holdings Inc	4.961	0,51
996 Ferroglobe Plc	3.422	0,35	220 Veeco Instruments Inc	4.908	0,50
CAD 859 Major Drilling Group International Inc	4.892	0,49	140 Vishay Precision Group Inc	3.305	0,34
	13.417	1,36		51.682	5,25
			Software – 3,86 % (29. Februar 2024: 2,01 %)		
			373 Alignment Healthcare Inc	5.861	0,60
			230 Digi International Inc	7.022	0,71
			263 Evolent Health Inc 'A'	2.365	0,24
			161 Five9 Inc	5.819	0,59
			267 I3 Verticals Inc 'A'	6.914	0,70
			219 Immersion Corp	1.757	0,18

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – (Fortsetzung)			Devisenterminkontrakte – -0,01 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
Software – (Fortsetzung)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
134 Privia Health Group Inc	3.350	0,34		-154	-0,01
244 Viant Technology Inc	4.869	0,50	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	37.957	3,86		-154	-0,01
Telekommunikation – 3,74 % (29. Februar 2024: 2,81 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
372 A10 Networks Inc	7.734	0,78		985.348	100,11
332 ADTRAN Holdings Inc	3.513	0,36	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
194 Applied Digital Corp	1.548	0,16		-1,014	-0,11
318 Aviat Networks Inc	6.658	0,68	Gesamtnettovermögen		
109 Clearfield Inc	3.540	0,36		984.334 \$	100,00
256 Gilat Satellite Networks Ltd	1.821	0,18	– 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 %.		
197 Gogo Inc	1.445	0,15	ABKÜRZUNGEN:		
584 Powerfleet Inc NJ	4.118	0,42	ADR	– American Depositary Receipt	
1.362 Ribbon Communications Inc	6.433	0,65	CAD	– Kanadischer Dollar	
	36.810	3,74	EUR	– Euro	
Transportwesen – 2,62 % (29. Februar 2024: 2,67 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
419 Ardmore Shipping Corp	3.801	0,39	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
151 Hub Group Inc 'A'	6.215	0,63	Organismen für gemeinsame Anlagen		
400 Navigator Holdings Ltd	6.062	0,61	Derivative Finanzinstrumente		
826 Radiant Logistics Inc	5.579	0,57	Sonstige Vermögenswerte		
104 Scorpio Tankers Inc	4.122	0,42	Gesamtvermögen		
	25.779	2,62	100,00		
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 928.028 \$)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 961.157 \$)					
Devisenterminkontrakte – 0,09 % (29. Februar 2024: 0,04 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
4. März 2025	BNY	Kauf CNH 201	Verkauf USD 28	\$ –
5. März 2025	BNY	Kauf USD 1.394	Verkauf BRL 7.989	37
5. März 2025	BNY	Kauf BRL 7.989	Verkauf USD 1.350	6
14. März 2025	BNY	Kauf USD 2.090	Verkauf AUD 3.316	34
14. März 2025	BNY	Kauf USD 109	Verkauf CNH 800	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 126	Verkauf CNH 908	1
14. März 2025	BNY	Kauf USD 31.009	Verkauf EUR 29.618	263
14. März 2025	BNY	Kauf USD 132	Verkauf EUR 127	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 358	Verkauf GBP 283	3
14. März 2025	BNY	Kauf USD 1.083	Verkauf PLN 4.308	19
14. März 2025	BNY	Kauf USD 5	Verkauf SEK 54	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 4	Verkauf SEK 47	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD 2.324	Verkauf SGD 3.109	22
14. März 2025	BNY	Kauf USD 758	Verkauf SGD 1.025	-2
14. März 2025	BNY	Kauf SGD 381	Verkauf USD 285	-2
14. März 2025	BNY	Kauf SGD 32.954	Verkauf USD 24.363	36
14. März 2025	BNY	Kauf SEK 5	Verkauf USD –	–
14. März 2025	BNY	Kauf SEK 1.224	Verkauf USD 112	1
14. März 2025	BNY	Kauf PLN 27.607	Verkauf USD 6.807	15
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 384	Verkauf USD 475	7
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 2.298	Verkauf USD 2.407	-25
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 89.799	Verkauf USD 92.767	446
14. März 2025	BNY	Kauf CNH 15.197	Verkauf USD 2.082	3
14. März 2025	BNY	Kauf AUD 11.028	Verkauf USD 6.932	-88
02. Apr. 2025	BNY	Kauf USD 54	Verkauf BRL 314	1
02. Apr. 2025	BNY	Kauf BRL 7.795	Verkauf USD 1.352	-37
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 292 \$)				\$ 894
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -170 \$)				-154
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 122 \$)				\$ 740

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,04 % (29. Februar 2024: 3,75 %)		
10 iShares Russell 2000 Value ETF –ETF	1.532	1,85
1.811 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.811	2,19
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.363 \$)	3.343	4,04
Stammaktien – 96,52 % (29. Februar 2024: 96,40 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 0,55 % (29. Februar 2024: 2,10 %)		
15 Leonardo DRS Inc	454	0,55
Bekleidung – 0,42 % (29. Februar 2024: 2,33 %)		
10 Steven Madden Ltd	344	0,42
Autoteile u. Ausstattung – 3,58 % (29. Februar 2024: 3,33 %)		
14 Gentex Corp	343	0,41
22 Miller Industries Inc/TN	1.275	1,54
16 Visteon Corp	1.349	1,63
	2.967	3,58
Biotechnologie – 0,98 % (29. Februar 2024: 0,79 %)		
14 Halozyme Therapeutics Inc	810	0,98
Baumaterialien – 0,56 % (29. Februar 2024: 2,04 %)		
CAD 10 Stella-Jones Inc	465	0,56
Chemie – 3,14 % (29. Februar 2024: 3,22 %)		
9 Innospec Inc	920	1,11
12 Quaker Chemical Corp	1.683	2,03
	2.603	3,14
Gewerbliche Dienstleistungen – 8,67 % (29. Februar 2024: 9,74 %)		
24 Cass Information Systems Inc	1.069	1,29
121 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.094	1,32
128 Forrester Research Inc	1.421	1,71
36 Korn Ferry	2.392	2,89
33 Valvoline Inc	1.211	1,46
	7.187	8,67
Computer – 1,08 % (29. Februar 2024: 0,52 %)		
16 Crane NXT Co	898	1,08
Kosmetik u. Körperpflege – 2,09 % (29. Februar 2024: 1,90 %)		
12 Interparfums Inc	1.735	2,09
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 7,22 % (29. Februar 2024: 8,07 %)		
38 Air Lease Corp 'A'	1.802	2,18
34 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.457	1,76
6 Houlihan Lokey Inc 'A'	979	1,18
35 Lazard Inc 'A'	1.742	2,10
	5.980	7,22
Elektronik – 10,17 % (29. Februar 2024: 6,67 %)		
27 Atmos Filtration Technologies Inc	1.065	1,28
21 Brady Corp 'A'	1.554	1,88
15 ESCO Technologies Inc	2.526	3,05
57 Knowles Corp	944	1,14
9 NEXTracker Inc 'A'	384	0,46
24 Sanmina Corp	1.954	2,36
	8.427	10,17
Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 3,73 % (29. Februar 2024: 3,75 %)		
26 Arcosa Inc	2.192	2,64
11 Exponent Inc	901	1,09
	3.093	3,73
Gesundheit – Produkte – 9,02 % (29. Februar 2024: 6,65 %)		
36 Bio-Techne Corp	2.243	2,71
62 Enovis Corp	2.378	2,87
61 Envista Holdings Corp	1.218	1,47
25 Haemonetics Corp	1.638	1,97
	7.477	9,02
Bauunternehmen – 5,78 % (29. Februar 2024: 3,11 %)		
5 Champion Homes Inc	519	0,63
4 Installed Building Products Inc	604	0,73
17 LCI Industries	1.777	2,14
16 MI Homes Inc	1.885	2,28
	4.785	5,78
Versicherung – 3,99 % (29. Februar 2024: 3,60 %)		
18 RLI Corp	1.397	1,69
13 Skyward Specialty Insurance Group Inc	670	0,81
1 White Mountains Insurance Group Ltd	1.238	1,49
	3.305	3,99

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Internet – 2,05 % (29. Februar 2024: 2,97 %)		
41 Ziff Davis Inc	1.702	2,05
Freizeit – 1,44 % (29. Februar 2024: 2,04 %)		
20 Brunswick Corp.DE	1.196	1,44
Beherbergung – 0,81 % (29. Februar 2024: 0,51 %)		
254 Century Casinos Inc	671	0,81
Maschinen – Diversifiziert – 3,02 % (29. Februar 2024: 3,52 %)		
12 Esab Corp	1.446	1,75
3 Kadant Inc	1.053	1,27
	2.499	3,02
Metallherstellung u. -elemente – 1,35 % (29. Februar 2024: 1,76 %)		
138 Janus International Group Inc	1.115	1,35
Fertigung diverse – 5,08 % (29. Februar 2024: 5,16 %)		
10 Enpro Inc	1.851	2,23
18 JBT Marel Corp	2.361	2,85
	4.212	5,08
Öl u. Gas – 0,75 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
10 Weatherford International Plc	624	0,75
Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,71 % (29. Februar 2024: 1,69 %)		
CAD 166 Pason Systems Inc	1.417	1,71
Pharma – 2,93 % (29. Februar 2024: 2,36 %)		
106 Catalyst Pharmaceuticals Inc	2.424	2,93
Immobilien – 6,13 % (29. Februar 2024: 4,63 %)		
286 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.778	3,35
60 Marcus & Millichap Inc	2.299	2,78
	5.077	6,13
Einzelhandel – 0,52 % (29. Februar 2024: 1,36 %)		
22 Movado Group Inc	427	0,52
Halbleiter – 8,78 % (29. Februar 2024: 9,55 %)		
14 Axcelis Technologies Inc	765	0,92
12 Cirrus Logic Inc	1.264	1,53
78 Cohu Inc	1.537	1,86
43 FormFactor Inc	1.420	1,71
25 MKS Instruments Inc	2.287	2,76
	7.273	8,78
Transportwesen – 0,97 % (29. Februar 2024: 1,56 %)		
5 Landstar System Inc	806	0,97
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 80.896 \$)	79.973	96,52
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 84.259 \$)		
	83.316	100,56
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	2	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	83.318	100,56
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	83.318	100,56
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
	-465	-0,56
Gesamtnettovermögen	82.853 \$	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:

ETF	– Börsengehandelter Fonds
CAD	– Kanadischer Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,76
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,00
Derivative Finanzinstrumente	–
Sonstige Vermögenswerte	0,24
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	45	Verkauf	EUR	43	\$	–
14. März 2025	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	1		–
14. März 2025	BNY	Kauf	SEK	13	Verkauf	USD	1		–
14. März 2025	BNY	Kauf	EUR	356	Verkauf	USD	368		2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1 \$)								\$	2
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)									–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 1 \$)								\$	2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,82 % (29. Februar 2024: 4,76 %)			USA – 42,06 % (29. Februar 2024: 46,01 %)		
122 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	122	2,82	1 Arcosa Inc	89	2,06
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 122 \$)	122	2,82	– Axcelis Technologies Inc	17	0,39
Stammaktien – 98,99 % (29. Februar 2024: 96,05 %)			– Brady Corp 'A'	31	0,71
Australien – 4,83 % (29. Februar 2024: 3,53 %)			– Brunswick Corp.DE	30	0,70
AUD 29 Hansen Technologies Ltd	90	2,08	2 Cognex Corp	57	1,32
AUD 18 IPH Ltd	53	1,22	– Dorman Products Inc	65	1,51
AUD 41 Johns Lyng Group Ltd	66	1,53	2 Enovis Corp	68	1,58
	209	4,83	– Enpro Inc	33	0,76
Belgien – 0,50 % (29. Februar 2024: 0,91 %)			1 Esab Corp	82	1,90
EUR 1 Azelis Group NV	21	0,50	– ESCO Technologies Inc	78	1,81
Brasilien – 1,06 % (29. Februar 2024: 1,68 %)			1 FormFactor Inc	28	0,65
BRL 25 Odontoprev SA	46	1,06	1 Haemonetics Corp	78	1,80
Kanada – 6,35 % (29. Februar 2024: 6,22 %)			– Houlihan Lokey Inc 'A'	42	0,97
1 Colliers International Group Inc	75	1,73	1 Innospec Inc	79	1,83
1 FirstService Corp	99	2,28	– Installed Building Products Inc	32	0,73
1 RB Global Inc	101	2,34	– Interparfums Inc	60	1,39
	275	6,35	1 JBT Marel Corp	92	2,12
Frankreich – 4,49 % (29. Februar 2024: 0,81 %)			– Kadant Inc	35	0,81
EUR 3 Antin Infrastructure Partners SA	38	0,89	5 Kennedy-Wilson Holdings Inc	50	1,15
EUR – Gaztransport Et Technigaz SA	73	1,68	– Landstar System Inc	39	0,91
EUR 1 Lectra	31	0,72	1 LCI Industries	60	1,39
EUR – Robertet SA	52	1,20	– Lincoln Electric Holdings Inc	35	0,82
	194	4,49	– Littelfuse Inc	93	2,15
Deutschland – 1,83 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			1 Marcus & Millichap Inc	32	0,74
EUR 1 CTS Eventim AG & Co KGaA	79	1,83	1 MKS Instruments Inc	70	1,62
Italien – 3,24 % (29. Februar 2024: 3,16 %)			1 Quaker Chemical Corp	88	2,04
EUR 2 Carel Industries SpA, 144A	38	0,88	– RU Corp	23	0,53
EUR – DiaSorin SpA	46	1,06	1 SEI Investments Co	107	2,48
EUR 11 GVS SpA, 144A	56	1,30	– Simpson Manufacturing Co Inc	31	0,72
	140	3,24	1 UFP Industries Inc	55	1,26
Japan – 11,27 % (29. Februar 2024: 11,23 %)			– Valmont Industries Inc	63	1,46
JPY 2 As One Corp	34	0,78	2 Valvoline Inc	76	1,75
JPY 3 BML Inc	55	1,28		1.818	42,06
JPY – Hirose Electric Co Ltd	35	0,81	Vietnam – 0,77 % (29. Februar 2024: 0,77 %)		
JPY 2 JCU Corp	53	1,22	GBP 3 XP Power Ltd	34	0,77
JPY – Maruwa Co Ltd/Aichi	68	1,57	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.287 \$)	4.278	98,99
JPY 1 OBIC Business Consultants Co Ltd	39	0,89	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	4.400	101,81
JPY 4 Riken Keiki Co Ltd	66	1,53	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	4.400	101,81
JPY 2 TKC Corp	58	1,35	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-78	-1,81
JPY 3 USS Co Ltd	27	0,63	Gesamtnettovermögen	4.322 \$	100,00
JPY 2 Zuken Inc	52	1,21			
	487	11,27			
Jersey – 2,08 % (29. Februar 2024: 0,77 %)					
GBP 7 JTC Plc, 144A	90	2,08			
Niederlande – 0,89 % (29. Februar 2024: 1,07 %)					
EUR – IMCD NV	38	0,89			
Polen – 1,36 % (29. Februar 2024: 1,26 %)					
PLN 2 Asseco Poland SA	59	1,36			
Südkorea – 1,95 % (29. Februar 2024: 1,76 %)					
KRW 10 NICE Information Service Co Ltd	84	1,95			
Schweden: 2,00 % (29. Februar 2024: 1,33 %)					
SEK 7 Karnov Group AB	55	1,28			
SEK 14 Norva24 Group AB	31	0,72			
	86	2,00			
Schweiz – 2,06 % (29. Februar 2024: 1,66 %)					
CHF – Kardex Holding AG	41	0,94			
CHF – VZ Holding AG	48	1,12			
	89	2,06			
Vereinigtes Königreich – 12,25 % (29. Februar 2024: 13,88 %)					
GBP 10 Ashtead Technology Holdings plc	63	1,46			
GBP 7 Auktion Technology Group Plc	47	1,09			
GBP 5 CVS Group Plc	65	1,51			
GBP 1 Diploma Plc	53	1,22			
GBP 11 DiscoverIE Group Plc	74	1,70			
GBP 1 Halma Plc	38	0,87			
GBP 1 Intertek Group Plc	80	1,86			
GBP 14 Marlowe Plc	62	1,44			
GBP 6 Rightmove Plc	47	1,10			
	529	12,25			

[^] 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 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 313 €)	
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	
Gesamtnettovermögen	

-
- 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[^] den Handel eingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
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.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
Hongkong – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
HKD 38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 14 \$)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtneutvermögen	– \$

– 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. April 2021 stellte der Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^] den Handel ein.

ABKÜRZUNGEN:

HKD – Hongkong-Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
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[^]_π

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 54 \$)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtneuvermögen	– \$

– 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.

π Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtver- mögens
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.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,92 % (29. Februar 2024: 1,31 %)					
198 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	198	0,92	12 NVIDIA Corp	1.520	7,07
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 198 \$)			3 ResMed Inc	607	2,82
			3 Veeva Systems Inc 'A'	637	2,96
			4 Zoetis Inc	624	2,90
				12.225	56,87
			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 20.134 \$)		
Stammaktien – 99,29 % (29. Februar 2024: 98,60 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 20.332 \$)		
Kanada – 2,92 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			Devisenterminkontrakte – 0,52 % (29. Februar 2024: 0,31 %)		
CAD – Constellation Software Inc/Canada	629	2,92	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	112	0,52
Dänemark – 4,40 % (29. Februar 2024: 2,83 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
DKK 2 Coloplast A/S	233	1,08	Devisenterminkontrakte – -0,01 % (29. Februar 2024: -0,02 %)		
DKK 8 Novo Nordisk A/S	714	3,32			
	947	4,40	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2	-0,01
Frankreich – 6,85 % (29. Februar 2024: 11,23 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
EUR 2 L'Oreal SA	744	3,46	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
EUR 3 Sartorius Stedim Biotech	728	3,39			
	1.472	6,85	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
Irland – 2,92 % (29. Februar 2024: 3,62 %)					
			Gesamt Nettovermögen		
EUR 8 Kingspan Group Plc	628	2,92			
Italien – 8,70 % (29. Februar 2024: 8,69 %)					
EUR 2 Ferrari NV	1.012	4,71			
EUR 13 Moncler SpA	858	3,99			
	1.870	8,70			
Niederlande – 9,72 % (29. Februar 2024: 10,18 %)					
EUR – Adyen NV, 144A	849	3,95			
EUR 1 ASML Holding NV	917	4,27			
EUR 3 BE Semiconductor Industries NV	322	1,50			
	2.088	9,72			
Schweden – 4,47 % (29. Februar 2024: 8,75 %)					
SEK 43 Atlas Copco AB	740	3,44			
SEK 19 Hexagon AB	220	1,03			
	960	4,47			
Schweiz – 2,44 % (29. Februar 2024: 0,00 %)					
CHF – Partners Group Holding AG	524	2,44			
USA – 56,87 % (29. Februar 2024: 51,20 %)					
AUD	4 Apple Inc	869	4,04		
	2 Autodesk Inc	665	3,09		
	2 Cadence Design Systems Inc	541	2,52		
	7 Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	378	1,76		
	3 CSL Ltd	462	2,15		
	4 Deckers Outdoor Corp	627	2,91		
	1 IDEXX Laboratories Inc	479	2,23		
	3 Illumina Inc	308	1,43		
	2 Linde Plc	859	4,00		
	1 Lululemon Athletica Inc	395	1,84		
	1 Mastercard Inc	855	3,98		
	1 Meta Platforms Inc 'A'	863	4,02		
	– Mettler-Toledo International Inc	489	2,28		
	3 Microsoft Corp	1.047	4,87		

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf USD 4.797	Verkauf EUR 4.589	\$ 35
14. März 2025	BNY	Kauf USD 81	Verkauf GBP 65	–
14. März 2025	BNY	Kauf USD –	Verkauf GBP –	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 1.241	Verkauf USD 1.537	23
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 234	Verkauf USD 245	-2
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 10.891	Verkauf USD 11.250	54
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 385 \$)				\$ 112
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): -22 \$)				-2
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 363 \$)				\$ 110

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.
Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,02 % (29. Februar 2024: 1,33 %)			
	5 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5	0,02
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 5 \$)			
		5	0,02
Stammaktien – 99,72 % (29. Februar 2024: 99,24 %)			
Brasilien – 5,38 % (29. Februar 2024: 6,81 %)			
BRL	173 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	305	0,95
BRL	107 Cosan SA	129	0,40
	– MercadoLibre Inc	487	1,53
BRL	113 Odontoprev SA	205	0,64
BRL	72 WEG SA	595	1,86
		1.721	5,38
Chile – 1,58 % (29. Februar 2024: 2,52 %)			
GBP	23 Antofagasta Plc	505	1,58
China – 30,57 % (29. Februar 2024: 20,48 %)			
HKD	59 Alibaba Group Holding Ltd	983	3,08
	5 Alibaba Group Holding Ltd ADR	643	2,01
HKD	10 BYD Co Ltd	455	1,42
HKD	140 China Merchants Bank Co Ltd	819	2,56
CNH	16 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	575	1,80
CNH	6 Eastroc Beverage Group Co -A	195	0,61
HKD	6 JD.com Inc	127	0,40
	8 JD.com Inc ADR	327	1,02
HKD	41 Meituan 'B', 144A	856	2,68
HKD	118 Minth Group Ltd	308	0,97
HKD	108 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	640	2,00
CNH	17 Proya Cosmetics Co., Ltd	203	0,64
CNH	47 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	467	1,46
CNH	5 Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co.,Ltd.	157	0,49
HKD	43 Tencent Holdings Ltd	2.648	8,29
	6 Trip.com Group Ltd ADR	364	1,14
		9.767	30,57
Hongkong – 1,77 % (29. Februar 2024: 1,97 %)			
HKD	74 AIA Group Ltd	566	1,77
Indien – 19,91 % (29. Februar 2024: 20,62 %)			
INR	6 Apollo Hospitals Enterprise Ltd	396	1,24
INR	68 HDFC Bank Ltd	1.344	4,21
INR	77 ICICI Bank Ltd	1.061	3,32
INR	23 Kotak Mahindra Bank Ltd	509	1,59
INR	16 Mahindra & Mahindra Ltd	488	1,53
	2 MakeMyTrip Ltd	231	0,72
INR	56 Reliance Industries Ltd	771	2,41
INR	11 Tata Consultancy Services Ltd	420	1,32
INR	20 Titan Co Ltd	706	2,21
INR	4 UltraTech Cement Ltd	436	1,36
		6.362	19,91
Indonesien – 1,90 % (29. Februar 2024: 4,57 %)			
IDR	989 Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	242	0,76
IDR	1.781 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	365	1,14
		607	1,90
Mexiko – 1,98 % (29. Februar 2024: 4,78 %)			
MXN	49 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	344	1,08
MXN	109 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	289	0,90
		633	1,98
Philippinen – 0,05 % (29. Februar 2024: 0,31 %)			
PHP	26 Robinsons Retail Holdings Inc	16	0,05
Polen – 1,09 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
PLN	20 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	350	1,09
Saudi-Arabien – 3,03 % (29. Februar 2024: 2,87 %)			
SAR	28 Al Rajhi Bank	759	2,38
SAR	3 Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	209	0,65
		968	3,03
Südafrika – 1,87 % (29. Februar 2024: 1,23 %)			
ZAR	4 Capitec Bank Holdings Ltd	596	1,87
Südkorea – 10,76 % (29. Februar 2024: 16,39 %)			
KRW	1 LG Chem Ltd	184	0,58
KRW	46 Samsung Electronics Co Ltd	1.711	5,35
KRW	13 Shinhan Financial Group Co Ltd	406	1,27
KRW	9 SK Hynix Inc	1.137	3,56
		3.438	10,76

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Taiwan – 17,91 % (29. Februar 2024: 12,76 %)			
TWD	42 Delta Electronics Inc	504	1,58
TWD	28 Globalwafers Co Ltd	318	0,99
TWD	27 MediaTek Inc	1.209	3,79
TWD	102 Quanta Computer Inc	757	2,37
TWD	96 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.935	9,18
		5.723	17,91
USA – 1,92 % (29. Februar 2024: 3,06 %)			
	1 EPAM Systems Inc	173	0,54
	3 Globant SA	441	1,38
		614	1,92
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 33.303 \$)			
		31.866	99,72
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 33.308 \$)			
		31.871	99,74
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
		–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
		31.871	99,74
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
		31.871	99,74
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
		82	0,26
Gesamtnettovermögen			
		31.953 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 856.000 \$ und machten 2,68 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
BRL	– Brasilianischer Real
CNH	– Chinesischer Renminbi
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
MXN	– Mexikanischer Peso
PHP	– Philippinischer Peso
PLN	– Polnischer Zloty
SAR	– Saudi-Riyal
TWD	– Taiwanesischer Dollar
ZAR	– Südafrikanischer Rand

	% des Gesamtver- mögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,64
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,02
Sonstige Vermögenswerte	1,34
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)	
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)				
5. März 2025	Goldman Sachs	Kauf	USD	9	Verkauf	ZAR	161	\$	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)									–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)									–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)									–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% vom Netto- inventar- wert	Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) EUR	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 99,25 % (29. Februar 2024: 98,91 %)				USA – 12,52 % (29. Februar 2024: 9,74 %)			
Dänemark – 8,29 % (29. Februar 2024: 3,82 %)				USD	9 Linde Plc	4.101	4,94
DKK	23 Coloplast A/S	2.349	2,83	USD	3 Mettler-Toledo International Inc	3.793	4,57
DKK	52 Novo Nordisk A/S	4.537	5,46		11 Schneider Electric SE	2.501	3,01
		6.886	8,29			10.395	12,52
Frankreich – 13,84 % (29. Februar 2024: 18,79 %)				Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 73.604 €)			
	91 Dassault Systemes SE	3.487	4,20			82.397	99,25
	12 L'Oreal SA	4.134	4,98	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert			
	19 Sartorius Stedim Biotech	3.868	4,66	bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 73.604 €)			
		11.489	13,84			82.397	99,25
Deutschland – 5,55 % (29. Februar 2024: 5,97 %)				Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	42 Infineon Technologies AG	1.493	1,80	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
	28 Nemetschek SE	3.115	3,75			–	–
		4.608	5,55	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert			
Irland – 5,05 % (29. Februar 2024: 4,84 %)				bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
	53 Kingspan Group Plc	4.190	5,05			82.397	99,25
Italien – 16,77 % (29. Februar 2024: 16,43 %)				Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)			
	17 Ferrari NV	7.712	9,29	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
	94 Moncler SpA	6.212	7,48			–	–
		13.924	16,77	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert			
Niederlande – 14,85 % (29. Februar 2024: 17,23 %)				bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
	2 Adyen NV, 144A	4.074	4,91			82.397	99,25
	9 ASML Holding NV	5.835	7,03	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
	22 BE Semiconductor Industries NV	2.422	2,91			620	0,75
		12.331	14,85	Gesamtneuvermögen			
Schweden – 11,55 % (29. Februar 2024: 13,41 %)						83.017 €	100,00
SEK	111 Assa Abloy AB	3.287	3,96	– 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 %.			
SEK	247 Atlas Copco AB	4.062	4,89				
SEK	202 Hexagon AB	2.240	2,70	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.074.000 € und machten 4,91 % des Nettovermögens aus.			
		9.589	11,55				
Schweiz – 6,33 % (29. Februar 2024: 4,51 %)				ABKÜRZUNGEN:			
CHF	7 Galderma Group AG	809	0,98	CHF	– Schweizer Franken		
CHF	3 Partners Group Holding AG	4.444	5,35	DKK	– Dänische Krone		
		5.253	6,33	GBP	– Britisches Pfund Sterling		
Vereinigtes Königreich – 4,50 % (29. Februar 2024: 4,17 %)				SEK	– Schwedische Kronen		
GBP	18 AstraZeneca Plc	2.648	3,19	USD	– US-Dollar		
GBP	794 Oxford Nanopore Technologies Plc	1.084	1,31				
		3.732	4,50				
				Verteilung des Gesamtvermögens			
				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			
				Sonstige Vermögenswerte			
				Gesamtvermögen			

FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Stammaktien – 98,27 % (29. Februar 2024: 99,00 %)		
Brasilien – 7,37 % (29. Februar 2024: 5,36 %)		
1 MercadoLibre Inc	1.145	7,37
Dänemark – 4,64 % (29. Februar 2024: 5,81 %)		
DKK 12 Novonosis (Novozymes) B	720	4,64
Frankreich – 4,14 % (29. Februar 2024: 4,74 %)		
EUR 21 Veolia Environnement SA	644	4,14
Indien – 5,02 % (29. Februar 2024: 4,82 %)		
13 HDFC Bank Ltd ADR	781	5,02
Indonesien – 1,51 % (29. Februar 2024: 3,18 %)		
IDR 1.144 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	235	1,51
Italien – 3,33 % (29. Februar 2024: 4,26 %)		
EUR 20 Amplifon SpA	517	3,33
Japan – 0,48 % (29. Februar 2024: 1,15 %)		
JPY 10 LITALICO Inc	75	0,48
Nigeria – 4,72 % (29. Februar 2024: 3,47 %)		
GBP 407 Airtel Africa Plc, 144A	733	4,72
Schweden – 2,06 % (29. Februar 2024: 1,54 %)		
SEK 7 MIPS AB	320	2,06
Vereinigte Arabische Emirate – 2,16 % (29. Februar 2024: 1,80 %)		
AED 744 Emirates Central Cooling Systems Corp	335	2,16
Vereinigtes Königreich – 8,86 % (29. Februar 2024: 9,80 %)		
GBP 8 Croda International Plc	346	2,23
GBP 26 FDM Group Holdings Plc	72	0,47
GBP 14 Halma Plc	485	3,12
GBP 37 Mears Group Plc	173	1,11
GBP 39 Vistry Group Plc	300	1,93
	1.376	8,86
USA – 53,98 % (29. Februar 2024: 53,07 %)		
21 Coursera Inc	167	1,07
1 Deere & Co	556	3,58
3 Ecolab Inc	800	5,15
11 Energy Recovery Inc	167	1,07
4 Exponent Inc	312	2,01
4 Illumina Inc	333	2,15
2 Intuitive Surgical Inc	1.141	7,35
3 Planet Fitness Inc 'A'	321	2,06
7 Revvity Inc	762	4,91
4 Stride Inc	513	3,30
1 Tyler Technologies Inc	641	4,13
2 Valmont Industries Inc	828	5,33
3 Veeva Systems Inc 'A'	639	4,11
18 Verra Mobility Corp 'A'	412	2,65
6 Xylem Inc.NY	794	5,11
	8.386	53,98

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Netto- inventar- wert
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 14.824 \$)		
	15.267	98,27
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 14.824 \$)		
	15.267	98,27
Devisenterminkontrakte – 0,15 % (29. Februar 2024: 0,08 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	24	0,15
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	15.291	98,42
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (29. Februar 2024: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	–	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	15.291	98,42
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	245	1,58
Gesamtvermögen		
	15.536 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 733.000 \$ und machten 4,72 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
AED	– Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate
DKK	– Dänische Krone
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
SEK	– Schwedische Kronen

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtver- mögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,30
Derivative Finanzinstrumente	0,15
Sonstige Vermögenswerte	2,55
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung von Kontrakten (in Tsd.)
14. März 2025	BNY	Kauf USD 3	Verkauf EUR 3	\$ –
14. März 2025	BNY	Kauf USD 37	Verkauf GBP 29	–
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 1.229	Verkauf USD 1.521	23
14. März 2025	BNY	Kauf GBP 4	Verkauf USD 6	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 1	Verkauf USD 1	–
14. März 2025	BNY	Kauf EUR 97	Verkauf USD 101	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 5 \$)				\$ 24
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (29. Februar 2024 (in Tsd.): 5 \$)				\$ 24

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2025

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Netto- inventar- wert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Netto- inventar- wert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 92,58 %					
Österreich – 1,07 %					
400 Raiffeisen Bank International AG, 4.625 %, fällig 21.08.2029 *	417	1,07			
Belgien – 2,77 %					
150 Azelis Finance NV, 4.750 %, fällig 25.09.2029	156	0,40			
400 Barry Callebaut Services NV, 4.000 %, fällig 14.06.2029	405	1,03			
500 KBC Group NV, 4.250 %, fällig 28.11.2029 *	524	1,34			
	1.085	2,77			
Tschechische Republik – 2,89 %					
500 Ceska sporitelna AS, 0.500 %, fällig 13.09.2028 *	472	1,20			
700 Raiffeisenbank AS, 1.000 %, fällig 09.06.2028 *	660	1,69			
	1.132	2,89			
Dänemark – 5,50 %					
500 Danske Bank A/S, 0.750 %, fällig 09.06.2029 *	468	1,20			
500 ISS Global A/S, 3.875 %, fällig 05.06.2029	516	1,32			
600 Jyske Bank A/S, 4.875 %, fällig 10.11.2029 *	638	1,63			
500 Nykredit Realkredit AS, 4.625 %, fällig 19.01.2029	529	1,35			
	2.151	5,50			
Frankreich – 20,57 %					
400 Air France-KLM, 4.625 %, fällig 23.05.2029	414	1,06			
500 Alstom SA, 0.000 %, fällig 11.01.2029	449	1,15			
400 Ayvens SA, 4.875 %, fällig 06.10.2028	426	1,09			
300 Ayvens SA, 3.875 %, fällig 16.07.2029	310	0,79			
200 Banijay Entertainment SAS, 7.000 %, fällig 01.05.2029	211	0,54			
600 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1.875 %, fällig 18.06.2029	565	1,44			
500 BNP Paribas SA, 1.125 %, fällig 17.04.2029 *	474	1,21			
500 BPCE SA, 3.875 %, fällig 11.01.2029	515	1,32			
500 CNP Assurances SACA, 1.250 %, fällig 27.01.2029	468	1,19			
500 Credit Agricole SA, 0.500 %, fällig 21.09.2029 *	460	1,17			
600 Credit Mutuel Arkea SA, 3.500 %, fällig 09.02.2029	607	1,55			
500 Forvia SE, 5.125 %, fällig 15.06.2029	510	1,30			
400 iliad SA, 5.375 %, fällig 15.02.2029	424	1,08			
400 Loxam SAS, 6.375 %, fällig 31.05.2029	422	1,08			
400 RCI Banque SA, 4.875 %, fällig 02.10.2029	425	1,09			
600 Societe Generale SA, 4.750 %, fällig 28.09.2029 *	633	1,62			
500 Suez SACA, 4.625 %, fällig 03.11.2028	528	1,35			
200 Valeo SE, 5.875 %, fällig 12.04.2029	212	0,54			
	8.053	20,57			
Deutschland – 5,54 %					
600 Aroundtown SA, 4.800 %, fällig 16.07.2029	629	1,61			
200 Birkenstock Financing Sarl, 5.250 %, fällig 30.04.2029	205	0,52			
500 Commerzbank AG, 5.250 %, fällig 25.03.2029 *	534	1,37			
300 Deutsche Lufthansa AG, 3.500 %, fällig 14.07.2029	306	0,78			
500 ZF Europe Finance BV, 4.750 %, fällig 31.01.2029	495	1,26			
	2.169	5,54			
Irland – 3,22 %					
400 AIB Group Plc, 5.750 %, fällig 16.02.2029 *	433	1,11			
300 Bank of Ireland Group Plc, 4.625 %, fällig 13.11.2029 *	318	0,81			
500 Dell Bank International DAC, 3.625 %, fällig 24.06.2029	510	1,30			
	1.261	3,22			
Italien – 6,64 %					
400 Autostrade per l'Italia SpA, 1.875 %, fällig 26.09.2029	381	0,97			
200 Fibercop SpA, 1.625 %, fällig 18.01.2029	184	0,47			
200 La Doria SpA, 7.115 %, fällig 12.11.2029 *	203	0,52			
400 Mundys SpA, 4.750 %, fällig 24.01.2029	419	1,07			
400 Nexi SpA, 2.125 %, fällig 30.04.2029	384	0,98			
400 Prysmian SpA, 3.625 %, fällig 28.11.2028	406	1,04			
200 TeamSystem SpA, 3.500 %, fällig 15.02.2028	199	0,51			
400 Webuild SpA, 5.375 %, fällig 20.06.2029	423	1,08			
	2.599	6,64			
Luxemburg – 3,11 %					
521 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1.750 %, fällig 12.03.2029	488	1,25			
350 Logisor Financing Sarl, 4.250 %, fällig 18.07.2029	362	0,92			
400 SELP Finance Sarl, 0.875 %, fällig 27.05.2029	366	0,94			
	1.216	3,11			
Niederlande – 4,65 %					
500 Cooperatieve Rabobank UA, 3.331 %, fällig 16.07.2028 *	500	1,28			
600 ING Groep NV, 4.500 %, fällig 23.05.2029 *	629	1,61			
200 Odido Holding BV, 3.750 %, fällig 15.01.2029	198	0,50			
300 Q-Park Holding I BV, 5.125 %, fällig 01.03.2029	311	0,79			
200 VZ Vendor Financing II BV, 2.875 %, fällig 15.01.2029	184	0,47			
	1.822	4,65			
Portugal – 1,38 %					
500 Caixa Geral de Depositos SA, 5.750 %, fällig 31.10.2028 *	539	1,38			
Rumänien – 0,54 %					
200 Banca Transilvania SA, 8.875 %, fällig 27.04.2027 *	211	0,54			
Slowenien – 0,51 %					
200 United Group BV, 6.806 %, fällig 01.02.2029 *	202	0,51			
Spanien – 8,99 %					
400 Abanca Corp Bancaria SA, 5.250 %, fällig 14.09.2028 *	423	1,08			
400 Abertis Infraestructuras SA, 4.125 %, fällig 07.08.2029	418	1,07			
500 Banco de Sabadell SA, 5.500 %, fällig 08.09.2029 *	539	1,38			
500 Banco Santander SA, 0.625 %, fällig 24.06.2029 *	466	1,19			
400 CaixaBank SA, 5.000 %, fällig 19.07.2029 *	427	1,09			
300 Ibercaja Banco SA, 4.375 %, fällig 30.07.2028 *	311	0,79			
200 Kaixo Bondco Telecom SA, 5.125 %, fällig 30.09.2029	204	0,52			
200 Lorca Telecom Bondco SA, 4.000 %, fällig 18.09.2027	201	0,51			
500 Unicaja Banco SA, 5.125 %, fällig 21.02.2029 *	531	1,36			
	3.520	8,99			
Schweden – 2,93 %					
500 Heimstaden Bostad Treasury BV, 0.750 %, fällig 06.09.2029	439	1,12			
400 Swedbank AB, 2.875 %, fällig 30.04.2029	399	1,02			
300 Volvo Car AB, 4.250 %, fällig 31.05.2028	307	0,79			
	1.145	2,93			
Schweiz – 1,45 %					
500 UBS Group AG, 7.750 %, fällig 01.03.2029 *	569	1,45			
Vereinigtes Königreich – 8,77 %					
400 Amber Finco Plc, 6.625 %, fällig 15.07.2029	424	1,08			
400 Lloyds Banking Group Plc, 4.500 %, fällig 11.01.2029 *	418	1,07			
600 NatWest Group Plc, 4.771 %, fällig 16.02.2029 *	632	1,61			
500 Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 3.625 %, fällig 20.06.2029	516	1,32			
300 Santander UK Group Holdings Plc, 0.603 %, fällig 13.09.2029 *	277	0,71			
800 Standard Chartered Plc, 0.800 %, fällig 17.11.2029 *	740	1,89			
400 Zegona Finance Plc, 144A, 6.750 %, fällig 15.07.2029	427	1,09			
	3.434	8,77			
USA – 12,05 %					
300 Aptiv Swiss Holdings Ltd, 1.600 %, fällig 15.09.2028	289	0,74			
400 Avantor Funding Inc, 3.875 %, fällig 15.07.2028	401	1,03			
400 Capital One Financial Corp, 1.650 %, fällig 12.06.2029	378	0,96			
400 Coty Inc, 5.750 %, fällig 15.09.2028	416	1,06			
300 Crown European Holdings SACA, 4.750 %, fällig 15.03.2029	314	0,80			
300 Energizer Gamma Acquisition BV, 3.500 %, fällig 30.06.2029	290	0,74			
500 Fidelity National Information Services Inc, 1.000 %, fällig 03.12.2028	468	1,19			
500 Goldman Sachs Group Inc/The, 0.875 %, fällig 09.05.2029	461	1,18			
500 IQVIA Inc, 2.250 %, fällig 15.03.2029	479	1,23			
600 Morgan Stanley, 4.656 %, fällig 02.03.2029 *	632	1,61			
600 WMG Acquisition Corp, 2.750 %, fällig 15.07.2028	589	1,51			
	4.717	12,05			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 35.333 €)				36.242	92,58
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 5,57 %					
Italien – 3,36 %					
1.300 Italien, Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 5Y, 3.000 %, fällig 01.10.2029	1.315	3,36			
Rumänien – 2,21 %					
800 Internationale Staatsanleihe Rumänien, 6.625 %, fällig 27.09.2029	865	2,21			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.174 €)				2.180	5,57
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				38.422	98,15
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				38.422	98,15
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				724	1,85
Gesamtvermögen				39.146 €	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen 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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Wertpapiere auf 427.000 € und machten 1,09 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2025.					
Verteilung des Gesamtvermögens					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					94,82
Sonstige Vermögenswerte					5,18
Gesamtvermögen					100,00

[^] 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 EUR Core Plus Bond Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ 42.180	\$ 11.569	€ 54	€ 1.317
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	857	1.697	1.944	4.243	–	1.090
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	1.705.250	1.126.235	100.247	190.499	238.432	813.413	–	47.809
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	14	–	–	–
Optionen	–	–	287	102	551	460	–	–
Swapkontrakte	–	–	259	1.346	632	10.341	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	232	416	–	16
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	212	156	1.256	1.495	–	9
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	3.992	2.944	15.418	9.664	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	4	109	1.192	1.264	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	5.208	2.161	695	1.419	1.789	6.463	–	473
Dividendenforderungen	–	–	1	17	1	7	–	13
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	1	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	1.710.459	1.128.397	106.554	198.289	303.641	859.335	54	50.727
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	116	1.402	–	1.193	–	60
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	324	1.640	692	5.946	–	7
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	1.266	740	–	5.842	–	–
Optionen	–	–	155	70	337	215	–	–
Swapkontrakte	–	–	190	1	706	1.640	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	296	1.408	–	15
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	20	75	634	552	–	224
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	24.733	9.918	6.253	8.473	51.223	24.808	–	525
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.908	3.318	107	166	97	158	–	2
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	785	513	58	95	148	385	–	3
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	41	30	13	18	24	57	3	8
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	5	9	8	20	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	28	49	357	1.503	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	236	200	117	91	346	353	51	54
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	29.703	13.979	8.652	12.829	54.868	44.080	54	898
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 1.680.756	\$ 1.114.418	\$ 97.902	\$ 185.460	\$ 248.773	\$ 815.255	€ –	€ 49.829
(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 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 899	\$ 1.100	\$ 15	\$ 15	\$ 17	\$ 17	\$ 8	\$ 12
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	165	101	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	40.625	47.559	–	–	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	35	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	39	34	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	57	8	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	295	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	37	59	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	537	673	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	42.395	49.829	15	15	17	17	8	12
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	235	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	99	8	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	65	24	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	1.214	736	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	59	90	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	30	33	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	9	10	–	–	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	38	103	1	1	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	92	70	14	14	17	17	8	12
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.606	1.310	15	15	17	17	8	12
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 40.789	\$ 48.519	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

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 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
\$ 671	\$ 675	\$ 18.668	\$ 15.928	\$ 2	\$ 682	\$ 24	\$ 23	\$	\$ 18
–	–	1.601	1.402	787	1.418	–	–	–	–
–	–	220.071	222.636	88.135	96.006	–	–	–	–
–	–	–	1	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	26	421	–	–	–	–
–	–	613	364	10	14	–	–	–	–
–	–	62	43	65	8	–	–	–	–
–	–	–	221	–	179	–	–	–	–
–	–	378	245	207	27	–	–	–	–
–	–	2.785	2.793	1.179	1.557	–	–	–	–
–	–	17	16	2	4	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1	–	–	–	–	–
671	675	244.195	243.649	90.414	100.316	24	23	–	18
–	–	–	–	296	–	–	–	–	–
–	–	73	39	93	237	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	20	219	–	–	–	–
–	–	–	–	11	–	–	–	–	–
–	–	1.070	1.576	5	1	–	–	–	–
–	–	532	139	–	–	–	–	–	–
–	–	829	541	1.762	2.660	–	–	–	–
–	–	68	86	149	163	–	–	–	–
–	–	107	94	59	57	–	–	–	–
–	2	22	22	12	13	–	–	–	–
–	–	7	6	3	5	–	–	–	–
661	662	13	102	971	35	11	11	–	–
10	11	151	104	80	48	13	12	–	18
671	675	2.872	2.709	3.461	3.438	24	23	–	18
\$ –	\$ –	\$ 241.323	\$ 240.940	\$ 86.953	\$ 96.878	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
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 EUR High Yield Fund [^]	
Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
\$ 256	\$ 48	\$ 2.298	\$ 3.781	\$ 7.442	\$ 3.684	\$ 206	\$ 211	€ –	€ 12
657	550	1.197	3.313	804	1.024	599	1.107	–	–
190.698	248.280	173.951	464.601	97.122	138.973	26.988	29.411	–	–
–	–	–	–	37	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
89	34	1.358	2.849	276	542	41	90	–	–
21	–	416	638	434	52	107	82	–	–
–	220	–	363	1.792	411	–	52	–	–
111	461	119	295	–	–	15	–	–	–
1.939	2.578	1.541	4.644	757	990	280	368	–	–
1	64	15	46	10	13	5	4	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
193.772	252.235	180.895	480.530	108.674	145.690	28.241	31.325	–	12
49	236	4	2	–	8	129	29	–	–
1	1	45	5	276	123	88	23	–	–
–	–	–	–	96	412	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	240	498	–	–	119	188	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
176	182	156	177	954	371	21	1	–	–
–	82	218	82	263	230	14	21	–	–
–	219	–	364	9.619	14.941	668	–	–	–
12	15	1	2	–	–	–	–	–	–
94	151	65	142	9	14	–	1	–	–
19	26	18	36	12	15	8	8	–	–
12	13	7	12	–	–	–	–	–	–
280	523	1.345	590	2	25	2	–	–	–
170	159	133	82	112	131	66	57	–	12
813	1.607	2.232	1.992	11.343	16.270	1.115	328	–	12
\$ 192.959	\$ 250.628	\$ 178.663	\$ 478.538	\$ 97.331	\$ 129.420	\$ 27.126	\$ 30.997	€ –	€ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^Δ		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund ^Δ		FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^Δ		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^Δ	
(in Tsd.)	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 4.056	\$ 26.798	\$ 23.004	\$ 4.674	\$ 50	\$ 3.392	\$ 36	\$ 73
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	33.984	2.003	3.657	2.491	1.450	2.916	2.654
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	1.150.354	376.567	361.536	512.078	519.423	1.323.526	1.178.166
Verpfändete Anlagen	–	69.547	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	5.129	304	93	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	82.650	207	232	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	8.511	4.968	1.501	7	12	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	18.244	729	620	–	166	1.668	313
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	1.403	787	1.216	–	–	81.727	224.075
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	445	684	459	–	899	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	19.663	4.151	4.748	2.038	2.040	5.527	4.961
Dividendenforderungen	–	332	–	8	1	84	20	72
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	4.056	1.417.060	413.404	378.744	516.665	527.466	1.415.420	1.410.314
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	4	–	1.022	–	533	–	3.121
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	56.547	241	119	–	–	1.668	72
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	21.032	6.335
Optionen	–	7.886	–	17	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	18.195	774	286	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	6.458	630	403	–	6	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	19.662	428	253	1.088	306	–	247
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	97.494	4.039	3.733	–	–	171.974	250.542
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	1.269	38	27	15	43	14	15
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	3	80	33	29	40	39	87	77
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	104	–	–	1	1	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.653	3.476	12	4	–	98	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.400	916	186	170	319	284	258	197
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	4.056	212.091	6.381	6.063	1.463	1.310	195.033	260.606
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ 1.204.969	\$ 407.023	\$ 372.681	\$ 515.202	\$ 526.156	\$ 1.220.387	\$ 1.149.708
	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{ΔΔ}	
(in Tsd.)	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1	\$ 13	\$ –	\$ 80	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.172
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	2.826	1.146	67	68	60	320	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	131.020	146.547	42.417	30.535	179.233	207.752	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	1.531	3.036	1	38	1.206	942	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	104	256	23	1	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	3.081	150	412	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	1	99	–	1	1	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	1.554	1.371	682	501	1.448	2.171	–	–
Dividendenforderungen	100	123	1	5	602	629	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	1	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	137.136	155.574	43.441	31.640	182.550	211.815	–	2.172
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	232	9	4	–	617	1	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	290	270	–	–	270	320	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	2.008	3.927	232	71	1.908	3.847	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	234	51	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	2.526	–	287	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	43	8	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	96	101	18	1	93	105	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	15	16	8	8	19	22	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2.176	–	60	2	16	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	228	228	49	41	136	128	–	2.172
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	3.104	9.305	354	476	3.045	4.439	–	2.172
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 134.032	\$ 146.269	\$ 43.087	\$ 31.164	\$ 179.505	\$ 207.376	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]				FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]				Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]				FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]				FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund			
Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024	
£	35	£	46	\$	47	\$	123	\$	543	\$	196	\$	16	\$	41	\$	3.259	\$	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	428	–	328	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	17.368	–	17.621	–	–	–	–	–	60.562	–	145.313
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	104	–	32	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	136	–	490	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	36	–	20	–	–	–	–	–	515	–	855
–	–	–	–	–	–	–	–	–	73	–	74	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	35	–	–	–	–	–	–	–	–	–	139
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	14	–	138
–	–	–	–	–	–	–	–	–	150	–	174	–	–	–	–	–	345	–	1.469
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	–	–	–	–	333	–	357
–	–	–	–	–	–	–	–	–	6	–	8	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
35	46	47	123	18.879	18.944	16	41	65.028	148.271										
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1	–	79
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	105	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	67	–	18	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	112	–	4	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	39	–	62	–	–	–	–	–	154	–	2.346
–	–	–	–	–	–	–	–	–	157	–	39	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	126	–	137	–	–	–	–	–	–	–	139
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	43	–	72
–	3	–	–	3	6	–	–	17	17	2	11	–	–	–	–	–	11	–	18
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	5	–	10
–	–	–	–	–	28	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	3.487	–	179
35	43	44	89	44	47	14	30	–	–	–	–	–	–	–	–	–	173	–	343
35	46	47	123	562	548	16	41	3.874	3.186										
£	–	£	–	\$	–	\$	–	\$	18.317	\$	18.396	\$	–	\$	–	\$	61.154	\$	145.085
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund				FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]				FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]				FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund [^]				FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^{^,γ}			
Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024		Zum 28. Februar 2025		Zum 29. Februar 2024	
\$	9.973	\$	2	\$	–	\$	–	\$	–	\$	15	\$	14	\$	15	\$	95	\$	2.984
3.298	5.330	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1.171
891.471	1.141.005	11.060	18.003	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	67.598
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3.659	6.119	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	430
713	55	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	14
–	894	–	4.373	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
482	2.418	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
12.358	16.923	149	246	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	930
8	89	–	3	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	7
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	4
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
921.962	1.172.835	11.209	22.625	–	15	14	15	95	73.138										
3	3.226	132	152	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	288
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
239	2.085	80	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3.340	4.746	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	1.463
–	274	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	167
–	4.968	–	663	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
128	147	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
533	681	5	3	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
70	82	8	13	–	2	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	3	–	11
57	74	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
2.263	4.823	–	5.311	–	–	–	–	–	–	–	–	14	15	–	–	–	–	–	–
245	349	87	80	–	13	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	92	–	171
6.878	21.455	312	6.222	–	15	14	15	95	2.101										
\$	915.084	\$	1.151.380	\$	10.897	\$	16.403	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	71.037

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{ΔΩ}		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^Δ		FTGF ClearBridge US Value Fund ^β	
	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 51	\$ 37	\$ 11	\$ –	\$ 5	\$ 22	\$ 40.351	\$ 17.644
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	63	72	1.087	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	15	15.831	36.607	30.675	–	–	1.140.429	1.142.135
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	54	–	–	–	–	802	622
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	1	22	14	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	3.823
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	48.617	1.295
Zinsen und sonstige Erträge	–	194	144	163	–	–	2	69
Dividendenforderungen	–	2	–	2	–	–	751	1.533
Verwaltungsgebühren	–	3	–	1	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	1	–	–	–	1	–
Gesamtumlaufvermögen	66	16.185	36.857	31.942	5	22	1.230.953	1.167.121
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	9	–	218	–	–	5.207	614
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	57	–	–	–	–	2	6
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	4	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	209	–	–	–	–	–	3.823
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	3	–	1	–	791	715
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	5	20	12	4	–	3	100	90
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	94	57
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	17	–	–	–	–	–	9.226	4.096
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	44	57	25	21	4	19	164	94
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	66	356	40	243	5	22	15.584	9.495
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ 15.829	\$ 36.817	\$ 31.699	\$ –	\$ –	\$ 1.215.369	\$ 1.157.626
	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund ^θ		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^Δ		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^{Δ*}	
	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 7.785	\$ 9.574	\$ 178	\$ 185	€ 16.063	€ 17.951	\$ –	\$ 24
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	912.104	1.367.716	27.201	16.583	718.183	807.917	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	926	370	–	–	158	26	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	9.448	–	95	–	450	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	3.614	1.647	–	–	1.443	747	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	6	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	452	658	17	9	1.703	1.466	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	1	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	924.881	1.389.419	27.397	16.872	737.550	828.557	–	24
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	5	5.786	–	–	1	1	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	3	16	–	–	1.213	891	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	10.962	–	52	–	450	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	399	583	13	3	598	655	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	85	105	8	8	57	69	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	47	115	–	–	81	76	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.729	6.183	–	50	1.257	3.388	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	257	159	47	41	172	104	–	24
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	3.525	23.909	68	154	3.379	5.634	–	24
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 921.356	\$ 1.365.510	\$ 27.329	\$ 16.718	€ 734.171	€ 822.923	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Legg Mason ClearBridge Growth 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	
Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
\$ 17	\$ 17	\$ 3.152	\$ 1.969	\$ 51.054	\$ 62.331	\$ 2.372	\$ 2.718	\$ 1.152	\$ 219
–	–	–	–	–	290	–	–	–	–
–	–	179.506	210.196	1.948.068	1.827.864	175.395	205.138	38.854	35.857
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1.978	392	21	7	4	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1.083	–	28	–	3
–	–	4	4	6.384	2.610	37	115	549	1
–	–	1	4	5	109	–	2	16	11
–	–	99	176	782	1.409	71	86	21	41
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1	–	–	–	–	–
17	17	182.762	212.349	2.008.272	1.896.088	177.896	208.094	40.596	36.135
–	–	398	6	3	2	143	–	–	74
–	–	–	–	2.000	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1.354	312	46	22	10	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	18.684	–	28	–	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	185	185	1.319	1.176	183	196	35	20
–	–	23	26	166	189	36	40	9	10
–	–	23	28	162	154	27	36	3	–
17	17	261	562	2.998	2.792	518	208	36	34
–	–	112	86	289	179	214	174	67	55
17	17	1.002	893	8.291	23.488	1.167	704	160	199
\$ –	\$ –	\$ 181.760	\$ 211.456	\$1.999.981	\$1.872.600	\$ 176.729	\$ 207.390	\$ 40.436	\$ 35.936
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 [^]	
Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
\$ 6.782	\$ 10.286	\$ 619	\$ 506	\$ 1.637	\$ 1.913	\$ 57	\$ 12	\$ –	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
281.612	326.235	6.117	5.144	984.608	689.142	83.316	96.082	4.400	4.422
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
198	255	–	–	894	292	2	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	294	–	3	204	3.223	–	294	24	–
53	27	–	–	2.407	6.008	122	64	–	–
–	–	–	1	13	13	2	1	–	–
1.136	2.107	12	9	385	406	16	34	5	7
–	–	2	6	–	–	–	–	1	11
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
289.781	339.204	6.751	5.669	990.148	700.997	83.515	96.488	4.430	4.440
2	–	3	–	28	4	309	–	11	8
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
69	124	–	–	154	170	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	5.843	–	3	408	1.393	–	343	47	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
253	296	–	–	928	595	97	97	–	–
33	28	28	10	85	74	14	15	6	6
31	51	–	–	166	111	13	12	–	–
2.150	989	–	–	3.853	3.599	151	25	–	–
94	64	21	15	192	161	78	61	44	40
2.632	7.395	52	28	5.814	6.107	662	553	108	54
\$ 287.149	\$ 331.809	\$ 6.699	\$ 5.641	\$ 984.334	\$ 694.890	\$ 82.853	\$ 95.935	\$ 4.322	\$ 4.386

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	Legg Mason US Equity Fund ^A		Franklin MV EURpean Equity Growth and Income Fund ^A		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^A		Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund ^A	
(in Tsd.)	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 23	\$ 23	€ 1.578	€ 1.417	\$ 2.239	\$ 2.264	\$ 61	\$ 61
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
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	–	–	4	11	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	23	23	1.582	1.428	2.239	2.264	61	61
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	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
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)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	2	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.193	1.175	2.213	2.213	59	59
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	23	23	389	253	26	49	2	2
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	23	23	1.582	1.428	2.239	2.264	61	61
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
	Legg Mason Martin Currie EURpean Absolute Alpha Fund ^{A*}		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund ^A		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund ^A		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund ^A	
(in Tsd.)	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	€ –	€ 83	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61	\$ 31	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	–	–	–	–	21.541	123.913
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	112	385
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	185	63
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	82
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	34	70
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	–	83	51	51	61	61	21.903	124.513
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	180
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	2	22
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	92	63
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	22	64
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	10	16
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	1	7
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	51	51	38	38	213	89
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	83	–	–	23	23	67	51
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	–	83	51	51	61	61	407	492
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 21.496	\$ 124.021

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

[illegible]

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	Franklin Responsible Income 2029 Fund ^α		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
(in Tsd.)				
UMLAUFVERMÖGEN:				
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	€ 800	€ –	\$ 255.064	\$ 216.937
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	22.772	67.581
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):				
Finanzanlagen	38.422	–	13.269.306	15.732.630
Verpfändete Anlagen	–	–	51	69.548
Optionen	–	–	1.246	5.817
Swapkontrakte	–	–	1.295	95.480
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	19.706	28.242
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	5.962	22.250
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	764	–	105.498	269.303
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	66.899	20.881
Zinsen und sonstige Erträge	518	–	46.777	80.950
Dividendenforderungen	16	–	6.838	10.289
Verwaltungsgebühren	–	–	15	44
Sonstige Vermögenswerte	1	–	9	2
Gesamtumlaufvermögen	40.521	–	13.801.438	16.619.954
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:				
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	7.693	18.339
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	6.160	65.750
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):				
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	22.394	13.329
Optionen	–	–	559	8.206
Swapkontrakte	–	–	2.480	23.116
Swaptions	–	–	11	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	13.952	28.790
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	3.588	22.426
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	1.329	–	274.491	466.191
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	4.572	4.155
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	14	–	7.147	8.560
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	7	–	1.263	1.478
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	757	910
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	41.936	48.290
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	25	–	8.686	10.107
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	1.375	–	395.689	719.647
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	€ 39.146	€ –	\$ 13.405.749	\$ 15.900.307

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 ¥/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 ¥/1.000 £.

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^α, 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, Franklin Responsible Income 2028 Fund^α und Franklin Responsible Income 2029 Fund^{αα} wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9640 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,9252).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Japan Equity Fund^α wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr zum USD/JPY-Schlusskurs von 150,5350 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 149,9200).

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 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7950 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,7922).

α Mit Wirkung vom 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund^α den Handel auf.

β Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

γ Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^α den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^α den Handel ein.

λ Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset EUR Core Plus Bond Fund^α den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^α den Handel ein.

θ Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund^α in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund^α umbenannt.

Ω Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^α den Handel ein.

π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 8. Mai 2025 von der Zentralbank widerrufen.

α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied
19. Juni 2025

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 Western Asset US Government Liquidity Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 399.438	3.271	122,10	\$ 243.001	2.080	116,83	\$ 164.832	1.477	111,57
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1.089.810	1.089.823	1,00	737.375	737.387	1,00	526.302	526.316	1,00
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	1	–	110,97	74	1	106,43
Klasse B USD Ausschüttend (D)	–	–	–	174	174	1,00	218	218	1,00
Klasse C USD Thesaurierend	175	2	113,32	168	2	109,18	153	1	105,01
Klasse C USD Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	134	1	1,00
Klasse X USD Ausschüttend (D)	190.664	190.666	1,00	133.030	133.032	1,00	141.184	141.186	1,00
Klasse A (G) USD Thesaurierend	482	4	122,36	461	4	117,06	481	4	111,80
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	180	180	1,00	201	200	1,00	230	230	1,00
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	7	7	1,00	7	7	1,00	7	7	1,00
FTGF Western Asset US Core Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 27.213	197	137,95	\$ 29.383	224	130,97	\$ 29.314	230	127,44
Klasse A USD Ausschüttend (D)	28.195	313	90,14	36.683	414	88,70	35.001	391	89,45
Klasse C USD Thesaurierend	3.121	25	125,98	3.877	32	120,21	5.503	47	117,55
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2.329	26	90,19	2.470	28	88,74	2.543	28	89,49
Klasse E USD Thesaurierend	1.040	11	93,00	1.002	11	88,85	803	9	86,98
Klasse F USD Thesaurierend	25.366	200	126,89	90.592	755	120,02	31.628	272	116,19
Klasse F USD Ausschüttend (D)	9.053	102	88,75	15.485	177	87,33	11.329	129	87,97
Klasse X USD Thesaurierend	345	3	111,19	1.499	14	105,04	2.156	21	101,70
Klasse X USD Ausschüttend (D)	201	2	87,72	198	2	86,29	266	3	87,02
Klasse Premier USD Thesaurierend	12	–	111,71	9	–	105,41	8.681	85	101,94
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	3.219	36	89,71	3.593	42	86,47
Klasse GA USD Thesaurierend	1.027	8	136,64	1.015	8	129,60	1.059	8	125,95
Klasse GE USD Thesaurierend	–	–	–	28	–	119,49	43	–	116,84
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 55.688	368	151,49	\$ 94.104	642	146,51	\$ 103.760	730	142,14
Klasse A USD Ausschüttend (D)	26.130	272	95,93	29.679	309	95,93	28.475	295	96,61
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	2.834	37	77,35	3.621	46	78,76	4.183	52	80,27
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	108	2	72,41	516	11	74,45	5.786	111	77,22
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	429	5	90,98	698	7	89,59	715	8	88,75
Klasse B USD Ausschüttend (D)	12	–	95,74	12	–	95,73	11	–	96,41
Klasse C USD Thesaurierend	10.291	76	135,52	16.755	127	131,73	16.162	126	128,45
Klasse C USD Ausschüttend (D)	6.573	68	96,61	8.069	84	96,61	7.865	81	97,30
Klasse E USD Thesaurierend	6.712	61	110,63	11.694	109	107,66	13.647	130	105,09
Klasse F USD Thesaurierend	65.888	541	121,71	415.738	3.552	117,03	524.507	4.647	112,86
Klasse F USD Ausschüttend (D)	6.956	77	89,96	8.584	95	89,96	8.486	94	90,60
Klasse X USD Thesaurierend	2.026	18	113,46	2.844	26	108,99	2.793	27	105,00
Klasse X USD Ausschüttend (D)	1.882	22	83,64	2.994	36	83,64	3.236	38	84,24
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	86	1	87,56	119	1	85,64	285	3	84,29
Klasse Premier USD Thesaurierend	60.901	414	147,05	202.351	1.435	141,03	374.417	2.760	135,67
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	326	4	91,01	4.507	49	91,09	2.837	31	91,71
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	99,38	–	–	96,22	31.663	316	94,59
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	–	–	–	10.586	135	78,43	16.273	206	78,97
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	325	3	119,61	1.375	11	117,39
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	12	–	141,52	34	–	135,77	34	–	131,13
Klasse A (G) USD Thesaurierend	83	1	153,83	174	1	148,81	169	1	144,38
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	786	8	96,68	794	8	96,68	833	9	97,37
Klasse B (G) USD Ausschüttend (D)	3	–	96,68	3	–	96,68	3	–	97,38
Klasse L (G) USD Thesaurierend	213	2	140,68	207	2	136,77	202	2	133,36
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	834	9	96,70	847	9	96,69	983	10	97,38
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^]									
Klasse A USD Ausschüttend (D)	€ –	–	–	€ 1.201	13	98,79	€ 35	–	93,08
Klasse A EUR Ausschüttend (D)	–	–	–	892	9	94,79	862	9	91,32
Klasse C USD Ausschüttend (D)	–	–	–	56	1	98,18	54	1	92,57
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	5.161	54	95,65	7.303	81	90,38
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	41.686	419	99,50	123.205	1.314	93,74
Klasse GA EUR Thesaurierend	–	–	–	467	4	118,00	636	6	112,08
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	267	3	106,14	278	3	101,67
Klasse GE EUR Thesaurierend	–	–	–	99	1	108,81	94	1	103,97
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 11.359	66	172,94	\$ 11.157	68	163,58	\$ 9.390	61	154,26
Klasse A USD Ausschüttend (D)	10.624	104	101,77	10.954	109	100,33	13.012	132	98,88
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1.276	15	86,42	1.479	17	85,24	1.619	19	83,98
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	2.620	34	76,22	1.369	18	77,00	683	9	77,14
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	233	5	71,50	138	3	72,88	166	3	74,10
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	860	6	139,90	1.578	11	134,67	3.009	22	129,52
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1.180	17	68,92	1.525	20	69,13	2.671	36	69,49
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	147	3	56,59	222	4	57,59	201	3	58,69
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	378	4	83,58	427	4	82,64	498	5	81,90
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	49	5	73,68	49	5	74,93	49	5	75,26
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	719	1.279	0,76	929	1.598	0,78	960	1.626	0,80
Klasse A ZAR ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	25.536	759	629,24	7.827	229	654,80	349	9	681,64
Klasse B USD Ausschüttend (D)	103	1	101,69	188	2	100,30	262	3	98,86
Klasse C USD Thesaurierend	4.839	31	154,10	5.572	38	146,50	6.279	45	138,84
Klasse C USD Ausschüttend (D)	6.854	67	101,74	7.866	78	100,30	8.448	85	98,85
Klasse E USD Thesaurierend	1.073	8	134,97	1.175	9	128,46	1.240	10	121,87
Klasse E USD Ausschüttend (D)	370	4	84,73	453	5	83,54	583	7	82,33
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	49	–	102,45	60	1	99,23	92	1	96,02
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	63	1	70,28	40	1	70,51	30	–	70,87
Klasse F USD Thesaurierend	21.553	132	163,08	19.213	125	153,36	17.061	119	143,75
Klasse F USD Ausschüttend (D)	4.311	51	84,74	4.382	52	83,54	4.951	60	82,33
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus	319	4	84,82	695	8	83,67	697	8	82,45
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	706	6	109,68	251	2	104,99	8	–	100,36
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	32	–	79,78	32	–	78,87	60	1	78,21
Klasse Premier USD Thesaurierend	38.328	193	198,71	36.527	196	186,39	34.965	201	174,28
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	356	3	105,67	349	3	104,23	368	4	102,68
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	59.720	522	103,38	59.744	522	101,29	54.671	522	98,72
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	730	5	142,37	781	5	135,82	1.365	10	129,55
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	10	–	66,58	33	–	66,82	39	1	67,15
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	207	2	80,64	337	3	79,76	827	9	79,03
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	135	2	69,64	135	2	69,27	203	2	69,00
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	2.548	71	144,25	2.701	80	134,58	2.666	95	124,47
Klasse P2 USD Thesaurierend	248	2	102,85	–	–	–	–	–	–
Klasse LM AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)	43.659	768	91,67	62.490	1.054	91,24	59.726	973	91,26
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	129	1	154,60	262	1	144,88	207	1	135,69
FTGF Western Asset US High Yield Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 16.752	78	213,65	\$ 15.896	82	194,34	\$ 18.805	105	179,29
Klasse A USD Ausschüttend (D)	23.440	335	70,05	24.756	361	68,50	27.885	411	67,77
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1.440	17	84,80	1.248	15	82,95	1.375	17	82,01
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	2.238	33	68,57	1.669	24	68,90	1.290	18	69,82
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1.241	18	67,29	1.385	19	66,93	1.403	20	67,53
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	153	12	100,90	–	–	102,01	5	–	94,71
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	2.934	6.289	0,63	583	1.216	0,65	383	776	0,66
Klasse B USD Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	46	1	67,77
Klasse C USD Thesaurierend	4.004	20	200,86	4.321	24	183,63	4.132	24	170,27
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2.426	35	70,06	1.778	26	68,50	2.074	31	67,78
Klasse E USD Thesaurierend	2.304	12	189,08	2.662	15	173,13	3.404	21	160,70
Klasse E USD Ausschüttend (D)	416	5	87,51	402	5	85,57	581	7	84,66
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	113	1	106,53	375	3	99,26	347	3	94,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	Gesamt-NIWF (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWF/ Anteil	Gesamt-NIWF (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWF/ Anteil	Gesamt-NIWF (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWF/ Anteil
FTGF Western Asset US High Yield Fund (Fortsetzung)									
Klasse F USD Thesaurierend	\$ 3.189	16	197,86	\$ 3.121	17	179,36	\$ 4.327	26	164,83
Klasse F USD Ausschüttend (D)	134	2	83,33	179	2	81,52	257	3	80,65
Klasse Premier USD Thesaurierend	16.680	81	207,10	20.612	110	187,18	35.228	205	171,58
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	122,92	4	–	111,24	1	–	102,60
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	1	–	91,40	–	–	89,40	1	–	88,37
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	85,88	30	–	85,40	28	–	86,14
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	7.451	96	77,58	15.675	207	75,89	21.415	285	75,02
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	12	–	126,08	11	–	113,95	40	–	104,43
Klasse A (G) USD Thesaurierend	208	1	218,32	204	1	198,80	189	1	183,52
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1.055	15	69,49	1.051	15	67,96	1.072	16	67,23
Klasse L (G) USD Thesaurierend	169	1	199,63	155	1	182,70	170	1	169,50
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	472	7	69,47	644	9	67,95	645	10	67,22
Klasse GF USD Thesaurierend	119	1	195,46	116	1	177,55	137	1	163,56
FTGF Western Asset Global High Yield Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 6.460	33	192,87	\$ 5.296	30	176,21	\$ 5.649	34	164,18
Klasse A USD Ausschüttend (D)	5.792	88	65,52	5.988	94	63,78	6.082	96	63,39
Klasse A USD Ausschüttend (M)	6.324	87	72,75	7.148	101	70,83	8.467	120	70,35
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	4.014	64	62,33	4.468	72	62,40	5.245	83	63,52
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	3.474	80	70,37	4.216	91	71,08	5.294	107	73,48
Klasse A EUR Thesaurierend	1.808	13	132,51	1.840	15	116,18	2.233	19	110,61
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	26	–	63,19	121	2	62,53	120	2	63,37
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.380	3.222	0,58	1.739	3.966	0,59	1.724	3.810	0,61
Klasse B USD Ausschüttend (D)	–	–	–	30	–	63,65	30	–	63,26
Klasse C USD Thesaurierend	844	5	180,99	916	6	166,18	920	6	155,61
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1.735	27	65,23	1.760	28	63,49	2.429	38	63,11
Klasse E USD Thesaurierend	606	4	164,73	749	5	151,67	1.123	8	142,35
Klasse E USD Ausschüttend (D)	161	2	80,32	166	2	78,18	165	2	77,70
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	77	1	62,84	52	–	62,22	14	–	63,06
Klasse F USD Thesaurierend	1.958	11	175,17	1.612	10	159,68	2.845	19	148,37
Klasse F USD Ausschüttend (D)	433	6	76,22	488	7	74,20	543	7	73,75
Klasse X USD Ausschüttend (D)	1.294	15	85,41	3.619	44	83,18	4.458	54	82,67
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	617	7	67,93	3.630	43	66,28	3.701	46	66,23
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	760	6	130,11	1.491	11	120,34	2.244	19	113,78
Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	29	–	73,84	28	–	72,07	27	–	72,01
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	1	–	93,26	1	–	90,78	1	–	90,17
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	87,52	30	–	86,67	29	–	87,81
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1.200	6	195,14	1.146	6	178,87	2.047	12	167,12
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	842	13	65,52	896	14	63,77	1.003	16	63,38
Klasse L (G) USD Thesaurierend	423	2	178,46	459	3	164,40	431	3	154,37
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	530	8	65,52	630	10	63,79	607	10	63,40
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 20.126	127	158,84	\$ 25.581	167	153,39	\$ 29.246	196	149,02
Klasse A USD Ausschüttend (D)	4.705	48	97,37	4.953	51	96,59	5.574	58	96,54
Klasse A USD Ausschüttend (M)	3.471	39	89,76	4.606	52	89,07	5.535	107	89,01
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.876	346	63,25	25.435	395	64,36	29.850	452	66,00
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	8.285	194	68,65	11.147	243	70,51	13.954	283	73,37
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	85,36	–	–	86,13	–	–	87,16
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	28.565	3.186	65,41	23.093	2.436	68,32	3.528	341	71,91
Klasse A EUR Thesaurierend	926	4	241,32	1.377	6	223,59	1.927	8	221,94
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	479	5	98,42	859	8	96,76	935	9	95,84
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	77	1	112,79	361	3	107,52	447	4	109,59
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	4.850	497	75,83	5.412	546	77,67	6.684	657	79,85
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	608	578	1,42	591	568	1,40	672	656	1,38
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.117	2.379	0,63	1.441	2.946	0,66	1.394	2.739	0,69
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	170	332	0,69	396	759	0,70	605	1.131	0,72
Klasse B USD Thesaurierend	58	–	152,25	56	–	147,41	54	–	143,57
Klasse C USD Thesaurierend	860	6	145,69	1.253	9	141,40	1.433	10	138,07
Klasse C USD Ausschüttend (D)	558	6	97,38	800	8	96,60	1.111	12	96,56
Klasse E USD Thesaurierend	311	2	125,40	483	4	121,83	590	5	119,08
Klasse E USD Ausschüttend (D)	191	2	89,51	185	2	88,79	181	2	88,75
Klasse F USD Thesaurierend	914	6	146,75	1.082	8	141,15	2.326	17	136,58
Klasse F USD Ausschüttend (D)	731	8	89,57	708	8	88,85	585	7	88,80
Klasse X USD Ausschüttend (M)	966	11	86,30	1.117	13	85,64	1.204	14	85,58
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	228	2	89,39
Klasse Premier USD Thesaurierend	47.899	271	176,62	55.334	327	169,46	83.254	509	163,56
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	1.371	13	102,87
Klasse Premier EUR Thesaurierend	2.261	13	170,76	29.793	175	157,55	120.289	732	155,45
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	2.985	26	112,18	3.732	32	109,56	8.187	72	107,84
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	16.118	156	99,71	21.356	208	95,08	69.572	678	96,97
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	11.028	102	104,64	10.943	102	99,65	10.936	102	101,76
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)	44	–	107,30	74	1	106,10	84	1	111,31
Klasse LM USD Thesaurierend	12.765	66	193,43	15.379	83	184,48	25.877	146	176,99
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	–	–	–	1.769	20	89,58	4.430	49	89,52
Klasse LM EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	1.296	15	82,67	1.358	15	84,23
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 29.867	223	134,17	\$ 32.186	253	126,97	\$ 30.772	254	121,01
Klasse A USD Ausschüttend (M)	10.599	97	108,80	10.728	102	104,94	7.663	75	101,67
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	5.602	56	96,31	15.241	152	92,69	21.104	222	90,07
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	313	3	98,80
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	5.787	644	96,72	10.828	1.203	93,27	12.582	1.452	90,68
Klasse A SEK Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	1	–	91,29	1	–	90,27
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	52	1	99,51
Klasse C USD Thesaurierend	3.028	24	124,06	3.635	31	118,00	3.828	34	113,01
Klasse C USD Ausschüttend (M)	117	1	107,60	3.832	37	103,78	3.761	37	100,53
Klasse E USD Thesaurierend	2.246	19	116,56	3.167	29	110,97	3.313	31	106,39
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1.175	11	103,19	1.163	12	99,53	4.856	50	96,49
Klasse F USD Thesaurierend	1.238	9	135,99	3.036	24	128,18	3.410	28	121,66
Klasse F USD Ausschüttend (D)	–	–	99,12	215	2	95,81	1.287	14	92,86
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	344	3	98,06	20.039	197	93,97	8.345	87	90,78
Klasse Premier USD Thesaurierend	10.740	72	149,39	13.167	94	140,44	25.521	192	132,97
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	4.402	40	99,36	4.697	42	100,08	–	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	31	–	103,53	12.290	115	98,95	65.972	653	95,51
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	250	2	100,95	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	139	1	139,04	191	1	130,91	565	4	124,65
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	2	–	102,17	61	–	98,73	13	–	96,15
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	27.457	268	102,32	56.466	570	99,06	29.107	302	96,32
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	99,71	28	–	95,09	27	–	91,66
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	4.685	51	88,51	12.489	133	87,18	6.422	70	86,37
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	71.203	589	96,05	274.828	2.336	93,18	285.334	2.604	91,09
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	9.722	155	93,22
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^									
Klasse A USD Ausschüttend (A)	\$ 1	–	94,81	\$ 17	–	93,66	\$ 1	–	91,31
Klasse X USD Thesaurierend	1.277	11	113,35	1.341	12	109,21	1.721	17	103,78
Klasse Premier USD Thesaurierend	24.802	161	154,41	25.994	175	148,60	25.147	178	141,02
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	224	2	102,34	22.399	207	100,29	20.636	201	97,14
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2	–	89,82	2	–	85,63
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2.447	40	99,96	5.009	84	96,21
Klasse P1 USD Thesaurierend	1	–	100,84	1	–	96,73	1	–	91,67
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	94,73	29	–	92,43	28	–	89,44
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	3.823	36	104,98	4.099	41	99,25

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 Western Asset Global Core Plus Bond Fund^Δ									
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	\$ 71.025	927	110,80	\$ 73.367	927	107,37	\$ 88.202	1.177	102,26
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.857	21	83,81
FTGF Western Asset Global Credit Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 267	2	141,17	\$ 795	6	132,56	\$ 2.174	17	127,27
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	79	1	116,42	252	2	111,18	321	3	108,91
Klasse X USD Thesaurierend	1	–	112,61	1	–	105,17	–	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	28	–	85,21	27	–	82,92
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	20	–	87,90	18	–	84,38
Klasse LM USD Thesaurierend	21.840	127	172,19	25.451	159	160,20	39.438	259	152,29
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	4.939	53	90,01	4.450	48	85,20	4.072	47	82,64
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^{Δ&}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 255.880	1.992	128,45	\$ 388.476	3.241	119,86
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	101.377	1.328	76,32	124.647	1.627	76,61
Klasse A USD Ausschüttend (S)	–	–	–	23.243	253	91,73	28.115	311	90,26
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.502	25	91,98	1.089	18	87,62
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	12.151	259	72,26	15.473	310	74,06
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	3.865	35	99,03	5.462	53	96,71
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	930	51	132,11	1.006	55	126,70
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	1.593	134	85,47	2.787	220	88,22
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	185.605	1.629	105,43	157.441	1.479	100,65
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	4.081	41	91,30	5.211	55	90,13
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	4.234	56	69,55	5.789	77	71,44
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	5.823	68	79,62	6.023	71	80,16
Klasse A GBP Thesaurierend	–	–	–	161	1	146,50	385	2	143,47
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	3.722	26	113,84	5.757	45	107,22
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	7.149	82	69,25	10.137	120	70,14
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	69	7	75,21
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	2	–	74,98
Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	253	4	10.003,12	154	2	9.123,43
Klasse A NOK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	4.442	532	88,61	6.043	740	84,75
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	976	105	96,33	1.390	158	92,28
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	6.917	7.805	1,19	9.979	11.868	1,13
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	17.973	33.238	0,73	25.125	45.526	0,74
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	29	50	0,78	29	50	0,79
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	91	1	107,65
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	30.958	271	114,30	34.826	325	107,20
Klasse C USD Ausschüttend (S)	–	–	–	3.922	43	90,81	4.194	47	89,36
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	10.586	94	112,53	15.021	142	105,64
Klasse E USD Ausschüttend (S)	–	–	–	983	11	90,58	1.410	16	89,13
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2.521	25	93,47	2.721	29	89,78
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	34.838	283	123,31	51.472	449	114,61
Klasse F USD Ausschüttend (S)	–	–	–	3.090	33	92,91	6.629	73	91,43
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	57.086	436	130,98	87.446	719	121,62
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	3.014	37	81,50	16.104	198	81,40
Klasse X USD Ausschüttend (S)	–	–	–	7.914	87	91,41	11.462	127	89,96
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	8.388	72	103,23	9.965	94	100,30
Klasse X EUR Thesaurierend	–	–	–	1.899	11	153,88	2.037	13	146,02
Klasse X EUR Ausschüttend (Abgesichert)	–	–	–	51.069	426	110,90	48.362	434	105,36
Klasse X EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	3.136	38	76,87	9.389	117	75,95
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	522	6	76,16	2.413	30	76,88
Klasse X GBP Thesaurierend	–	–	–	911	5	153,58	964	5	149,67
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	23.562	155	120,69	38.851	286	113,11
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	1.358	14	74,59	1.878	21	75,17
Klasse X SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2.243	2.410	1,25	4.358	4.958	1,19
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	46.954	342	137,29	242.867	1.908	127,29
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	–	–	–	14.313	157	91,20	23.154	258	89,75
Klasse Premier AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	836	13	98,05	850	14	92,81
Klasse Premier AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	983	17	86,86	2.742	47	87,39
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	28.142	794	176,12	38.397	1.288	156,04
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	3.432	31	98,95	4.384	43	96,00
Klasse Premier CHF Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	1.106	13	74,48	1.151	14	76,70
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	14.867	86	160,49	22.074	137	151,92
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	93.921	794	109,45	361.662	3.293	103,82
Klasse Premier EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	27.308	322	78,39	37.969	455	78,94
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	4.217	29	113,89	6.545	51	106,58
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	17.316	187	73,20	19.336	218	73,65
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	46.942	712	9.886,79	52.479	733	9.751,61
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.945	74	104,43	1.116	52	96,27
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	27	3	101,75	25	3	96,83
Klasse P2 USD Thesaurierend	–	–	–	11	–	143,01	11	–	132,05
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2.596	20	119,87	147.182	1.229	113,27
Klasse LM AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	9.507	176	82,92	19.202	342	83,45
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	640	4	140,26	1.173	8	131,56
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 24	–	112,63	\$ 45	–	105,94
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1	–	75,64	41	1	76,66	42	1	78,10
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	5	–	100,92	26	–	96,32	24	–	92,46
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	1	–	111,66	1	–	105,15
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)	24.944	372	10.093,89	–	–	–	–	–	–
Klasse X CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	40	1	67,31	40	1	70,41
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	193	2	79,35
Klasse P2 USD Thesaurierend	1.231	12	106,08	1.397	14	98,47	1.443	16	91,70
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	19.399	200	87,58	19.394	200	85,76	19.240	200	90,61
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)	4.133	40	93,30	4.410	40	97,52	4.180	40	98,43
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.322	181	102,90	17.967	171	97,16	19.433	199	92,33
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	49.325	360	108,94	39.226	306	101,40	31.373	274	95,04
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	16.975	231	106,24	17.064	233	99,28	17.807	262	92,76
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	35.543	327	104,85	42.308	397	98,62	30.300	307	93,33
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	236.145	1.389	135,19	230.783	1.459	125,34	150.891	1.072	117,01
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^Δ									
Klasse D USD Thesaurierend	\$ 805	7	118,15	\$ 1.564	14	107,97	\$ 12.154	119	101,95
Klasse D USD Ausschüttend (M)	1.073	14	78,94	737	9	78,16	1.461	18	80,39
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	211	3	71,98	219	3	74,86
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.017	10	101,94	994	10	94,69	958	10	91,07
Klasse D EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	348	5	73,01
Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	73	1	99,30	71	1	94,12	299	3	91,94
Klasse M USD Ausschüttend (M)	881	11	78,62	800	10	77,85	747	9	80,06
Klasse M EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	54	1	99,37	50	1	95,01
Klasse Premier USD Thesaurierend	18.728	123	152,31	72.263	523	138,14	78.484	606	129,48
Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)	4.619	57	80,67	8.801	110	80,01	8.643	105	82,24
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	178	1	128,98	576	4	118,91	4.182	35	113,55
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	147	2	70,33	154	2	70,91	523	7	74,31
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	85	1	74,62
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	41.500	500	11.303,04
Klasse LM USD Thesaurierend	487.681	3.021	161,43	439.931	3.023	145,54	409.895	3.023	135,60
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^Δ									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 9	–	74,48	\$ 9	–	73,19	\$ 9	–	74,87
Klasse Premier USD Thesaurierend	58.146	545	106,69	61.613	615	100,18	57.381	585	98,09
Klasse LM USD Thesaurierend	1.162.232	10.625	109,38	1.088.086	10.625	102,41	1.062.117	10.625	99,96

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]									
Klasse A GBP Thesaurierend	£ –	–	–	£ –	–	–	£ 1	–	97,14
Klasse Premier GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	83,09
Klasse LM GBP Ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	45.910	504	91,11
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 102	1	108,03
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	16.144	164	98,52
Klasse S USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	90,61
Klasse LM GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	78.528	704	92,75
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]									
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	\$ 18.317	257	71,28	\$ 18.396	254	72,41	\$ 18.441	250	73,76
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 9	–	85,86
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	9	–	86,26
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	2.138	25	86,50
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.540	140	94,89
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	39	–	84,26
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	38	–	85,61
Klasse S USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	4.183	48	86,60
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	39	–	84,36
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 5.979	49	123,11	\$ 7.846	64	122,99	\$ 9.739	79	122,52
Klasse A USD Ausschüttend (M)	697	10	69,63	753	10	72,35	521	7	75,50
Klasse A USD Ausschüttend (S)	6.321	74	85,98	14.513	162	89,80	17.976	192	93,73
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	384	13	48,89	174	5	52,13	381	10	56,40
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	8.281	120	66,32	567	8	67,44	717	10	68,79
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	13.441	96	130,11	14.676	107	130,10
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	91	2	52,24	117	2	55,76	305	5	58,95
Klasse A EUR Ausschüttend (S)	35	–	73,70	37	–	73,87	41	–	78,82
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	3.924	38	100,08	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	4.861	54	82,53	5.444	60	86,44
Klasse A GBP Thesaurierend	–	–	–	87	1	87,90	87	1	91,89
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	77	1	56,94	86	1	59,42	204	3	62,54
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	2.089	16	101,11	–	–	–	–	–	–
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	2.649	23	92,67	3.053	27	95,78
Klasse A SGD Thesaurierend	14	23	0,84	63	101	0,84	60	97	0,84
Klasse B USD Thesaurierend	7	–	110,99	–	–	111,16	7	–	111,01
Klasse B USD Ausschüttend (S)	–	–	–	44	–	89,76	63	1	93,69
Klasse C USD Thesaurierend	297	3	106,36	298	3	106,78	285	3	106,92
Klasse C USD Ausschüttend (S)	725	8	85,61	750	8	89,40	833	9	93,31
Klasse E USD Thesaurierend	325	4	80,96	654	8	81,37	666	8	81,55
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	378	4	100,45	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	431	4	91,65	492	5	92,19
Klasse F USD Thesaurierend	7.353	83	88,50	174	2	88,07	182	2	87,39
Klasse F USD Ausschüttend (S)	73	1	63,44	76	1	66,24	79	1	69,16
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	8	–	101,37	–	–	–	–	–	–
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	21	–	76,53	24	–	79,11
Klasse X USD Thesaurierend	55	1	89,02	2.374	27	88,48	2.545	29	87,70
Klasse X USD Ausschüttend (S)	35	1	63,74	35	1	66,56	35	1	69,49
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	120	2	73,32	29	–	74,20	97	1	75,27
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	732	8	89,19	315	3	88,76
Klasse X EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	8	–	75,89
Klasse X GBP Thesaurierend	5.875	43	108,20	12.765	94	107,21	17.560	131	111,55
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	2.068	21	76,88	4.296	44	76,77	5.057	55	76,86
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	114	1	95,81	162	1	94,07
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	7.270	103	56,37	5.847	78	59,06	6.551	88	62,22
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	3.828	39	78,16	4.031	41	80,78
Klasse Premier USD Thesaurierend	2.031	20	103,86	21.414	208	103,09	21.695	213	102,03
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	14	–	65,77	24	–	68,68	110	2	71,71
Klasse Premier EUR Thesaurierend	1.279	9	137,10	2.300	16	130,58	2.927	21	132,08
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.262	17	71,41	1.245	16	72,28	1.864	24	73,25
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	6.583	54	112,34	4.278	36	111,56
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	78,71	–	–	78,49	3	–	78,48
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	44	1	56,44	54	1	58,87	99	1	62,01
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	102	1	101,53	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	345	3	84,20	672	6	87,04
Klasse LM USD Thesaurierend	3.940	44	90,29	2.860	32	89,08	3.149	36	87,64
Klasse LM USD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	32.588	290	112,52	35.016	322	108,78
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 595	5	119,54	\$ 599	5	116,57	\$ 847	7	114,61
Klasse A USD Ausschüttend (A)	149	2	88,17	145	2	90,30	142	2	91,28
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	102	1	90,86	157	2	90,29	230	2	90,77
Klasse A SGD Thesaurierend	2	2	1,02	1	2	0,99	1	1	0,97
Klasse C USD Thesaurierend	344	3	102,53	367	4	100,48	69	1	99,28
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	71	1	98,39
Klasse E USD Ausschüttend (A)	21	–	89,22	22	–	91,37	23	–	92,36
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	28	–	108,20	519	5	105,96
Klasse X USD Thesaurierend	177	2	102,96	172	2	99,91	168	2	97,77
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	2.709	21	102,85	2.640	21	100,18	2.468	21	98,87
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	49	1	76,75	86	1	79,19	403	4	82,44
Klasse Premier USD Thesaurierend	121.878	1.048	116,35	121.526	1.078	112,78	226.102	2.052	110,21
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	160	2	90,05
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2.505	23	105,19	3.047	27	103,85	103.945	947	103,83
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	26.284	337	73,84
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	7	–	74,46	12.202	126	76,87	9.234	96	80,03
Klasse LM USD Thesaurierend	5.494	44	125,87	5.277	44	120,91	5.111	44	117,09
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	163.494	1.698	143,13
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 6.388	46	140,38	\$ 2.744	21	128,99	\$ 260	2	114,70
Klasse A USD Ausschüttend (D)	7.161	82	87,09	1.384	16	85,59	91	1	81,94
Klasse F USD Thesaurierend	38	–	106,91	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (D)	1.593	16	102,16	75	1	100,28	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	6	–	176,31	6.557	41	160,88	1	–	142,10
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	87	–	173,71	80	–	157,47	67	–	140,14
Klasse P2 USD Thesaurierend	1.056	10	103,23	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	17.986	155	168,40	11.283	100	153,44	9.975	100	136,39
Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	8.772	74	115,03	9.041	74	113,79	–	–	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1.060	10	102,02	\$ 2.826	27	105,16	\$ 3.169	31	102,90
Klasse A USD Ausschüttend (M)	227	3	79,00	512	6	85,59	583	7	87,66
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	5	–	69,92	6	–	73,54	1	–	73,48
Klasse A SGD Thesaurierend	12	20	0,86	14	21	0,88	23	36	0,87
Klasse C USD Thesaurierend	97	1	92,01	131	1	95,33	129	1	93,75
Klasse E USD Thesaurierend	580	6	89,85	290	3	93,18	281	3	91,73
Klasse F USD Thesaurierend	563	6	90,04	1.967	21	92,45	2.342	26	90,10
Klasse F USD Ausschüttend (M)	312	5	67,72	220	3	73,37	231	3	75,15
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	261	3	94,17
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	39	1	58,74	39	–	64,06	135	2	66,38
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	808	7	87,03	970	9	88,36

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD Thesaurierend	\$ 163.343	1.490	109,65	\$ 183.751	1.636	112,30	\$ 175.727	1.610	109,17
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	1.816	17	83,14	1.835	18	84,39
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	5.225	62	150,57	5.709	62	151,23	5.577	62	145,48
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	1.621	14	109,57	3.990	35	108,20
Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	8.042	80	179,55	7.666	70	179,20	9.892	93	171,35
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 148.178	1.044	141,99	\$ 186.183	1.370	135,93	\$ 184.162	1.434	128,45
Klasse A USD Ausschüttend (A)	610	7	87,28	1.619	18	87,86	1.913	22	86,14
Klasse A USD Ausschüttend (D)	12.539	152	82,30	16.750	200	83,74	15.995	192	83,26
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.985	290	75,82	28.773	369	78,01	36.853	469	78,56
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	69.769	880	79,27	86.736	1.061	81,76	103.737	1.260	82,33
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	2.713	48	90,78	2.883	51	87,60	2.736	48	84,05
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	863	19	73,78	1.471	30	76,50	2.007	38	78,18
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1.649	170	70,76	1.260	121	74,73	871	78	77,28
Klasse A CZK Thesaurierend (Abgesichert)	480	11	1.087,72	35	1	1.048,15	28	1	979,39
Klasse A EUR Thesaurierend	2	–	111,87	2	–	102,70	2	–	99,13
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	27.557	259	102,56	44.018	408	99,82	32.034	315	96,30
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	19.905	238	80,71	26.885	301	82,59	27.469	314	82,68
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)	1	–	102,14	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	102,14	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.334	18	71,41	1.975	24	74,76	2.230	27	76,87
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	24.857	367	65,32	30.592	413	68,53	33.044	443	70,47
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.411	15	74,70	2.024	21	77,11	2.189	23	78,20
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	4.033	44	72,46	6.130	65	74,94	6.204	68	75,97
Klasse A HKD Thesaurierend	637	53	93,84	653	56	90,45	577	53	85,70
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	6.579	673	76,03	8.043	800	78,76	9.913	978	79,53
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	23.886	40.666	0,79	33.994	54.979	0,83	37.208	58.904	0,85
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20.913	38.744	0,73	23.558	41.347	0,77	24.225	41.619	0,78
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	2.101	3.679	0,77	3.324	5.658	0,79	5.130	8.666	0,80
Klasse C USD Thesaurierend	8.408	86	97,78	16.481	175	94,08	22.302	250	89,35
Klasse C USD Ausschüttend (D)	11.248	139	80,84	11.912	145	82,24	9.667	118	81,77
Klasse E USD Thesaurierend	20.161	191	105,67	35.624	350	101,77	30.426	314	96,75
Klasse E USD Ausschüttend (D)	778	10	80,63	836	10	82,02	611	7	81,55
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	4.856	48	97,73	5.546	54	95,83	4.425	45	93,02
Klasse F USD Thesaurierend	14.166	140	101,48	20.610	213	96,71	25.037	275	90,98
Klasse F USD Ausschüttend (D)	3.238	36	89,86	5.158	56	91,43	5.074	56	90,91
Klasse X USD Thesaurierend	6.129	59	103,17	4.666	48	98,12	9.584	104	92,12
Klasse X USD Ausschüttend (D)	1	–	89,96	1	–	91,51	387	4	90,97
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	13.592	162	84,16	14.868	172	86,24	17.624	204	86,27
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	88	1	82,57
Klasse X CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	396	5	80,59
Klasse X EUR Thesaurierend	1.222	10	113,35	1.012	9	103,52	972	9	99,36
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	794	8	90,14	8.687	92	87,36	15.314	173	83,73
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	102,23	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1.889	26	69,58	12.324	157	72,59	16.053	205	74,16
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1.659	17	77,35	2.973	30	79,52	5.206	54	80,09
Klasse Premier USD Thesaurierend	87.347	852	102,46	86.074	885	97,30	51.346	563	91,22
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	8.002	93	86,39	15.699	178	88,40	19.197	217	88,30
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	156	7	107,56	2.211	121	96,03
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	42.958	356	116,45	69.864	574	112,55	91.195	801	107,70
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	102,23	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	18.420	250	70,99	42.042	527	73,85	41.888	526	75,35
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	339	3	80,35	6.824	70	80,81
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	2.372	219	116,56	2.473	227	112,78	2.027	196	107,98
Klasse P2 USD Thesaurierend	88.123	828	106,43	87.617	868	100,97	90.056	952	94,56
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	2.099	26	80,31	74	1	81,85	208	3	81,54
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	8.835	79	107,97	38.772	344	104,20	49.405	469	99,63
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	3.485	42	80,38	4.483	50	83,51	5.144	57	85,09
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	51	1	81,19	75	1	83,23	284	3	83,61
Klasse LM USD Thesaurierend	16.824	149	112,59	15.905	149	106,44	11.406	115	99,33
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	5.850	72	81,38	4.097	49	82,79	6.126	75	82,22
Klasse LM EUR Thesaurierend (M) Plus (e)	8.147	82	99,12	1	–	100,36	–	–	–
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	102,28	–	–	–	–	–	–
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	131.628	1.670	75,99	113.322	1.337	78,43	115.356	1.372	79,49
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	10.796	84	101,90	22.781	187	96,55	25.939	238	90,69
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 2.080	17	122,48	\$ 371	3	112,79	\$ 12.219	109	111,73
Klasse X USD Ausschüttend (M)	1	–	90,85	1	–	90,21	1	–	94,36
Klasse Premier USD Thesaurierend	8.816	67	131,28	12.037	100	120,11	30.650	259	118,21
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	3.994	30	133,95	3.886	30	130,32
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^Δ									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 75	1	75,72
Klasse S EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	8.314	100	78,60
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^{Δγ}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 29	–	86,87	\$ 27	–	82,04
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	75	120	0,84	72	120	0,81
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	4	–	60,49	4	–	61,32
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	70.929	1.223	89,24	69.307	1.223	84,23
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^{ΔΩ}									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ –	–	–	\$ 101	1	96,21	\$ 98	1	97,52
Klasse P1 USD Thesaurierend	–	–	–	15.597	148	105,56	14.581	148	98,69
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	105	1	94,75	101	1	96,98
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	26	–	103,03	24	–	97,01
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1	–	110,53	\$ 1	–	105,44	\$ –	–	–
Klasse P1 USD Thesaurierend	36.816	331	111,24	31.698	300	105,66	–	–	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 650	3	191,94
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	581	3	205,43
Klasse Premier GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3	–	108,28
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.300	7	180,30
FTGF ClearBridge US Value Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 118.178	561	210,81	\$ 121.992	663	183,96	\$ 123.192	764	161,25
Klasse A USD Ausschüttend (A)	35.028	87	400,53	31.475	90	349,52	32.769	107	306,36
Klasse A EUR Thesaurierend	24.588	92	257,03	20.509	88	215,29	10.721	53	192,77
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.338	10	132,41	513	4	117,54	2.900	26	105,31
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	26	–	186,21	47	–	165,46	163	1	148,17
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	78	–	299,96	25	–	260,70	22	–	239,81
Klasse A SGD Thesaurierend	6.070	4.642	1,77	5.626	4.930	1,54	4.485	4.483	1,35
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1.574	661	3,22	1.569	737	2,86	1.709	903	2,55
Klasse C USD Thesaurierend	14.249	68	210,26	9.640	52	184,40	11.911	73	162,44
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2.882	8	357,87	2.951	9	313,86	2.870	10	276,49
Klasse E USD Thesaurierend	7.432	56	132,11	3.173	27	116,15	4.195	41	102,58
Klasse F USD Thesaurierend	34.378	81	425,57	27.705	75	369,14	25.113	78	321,62
Klasse F USD Ausschüttend (A)	403	2	233,54	367	2	203,38	385	2	177,83
Klasse X USD Thesaurierend	3.640	26	138,91	1.773	15	120,27	110	1	104,72

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 ClearBridge US Value Fund^β (Fortsetzung)									
Klasse X USD Ausschüttend (A)	\$ 9.519	33	292,59	\$ 3.786	15	254,51	\$ 1.839	8	222,54
Klasse X EUR Thesaurierend	220.644	1.244	170,94	5.778	38	142,09	4.337	32	126,47
Klasse Premier USD Thesaurierend	399.930	1.026	389,93	582.482	1.730	336,79	546.618	1.871	292,19
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	243	1	261,42	75	–	227,57	2.347	12	198,95
Klasse Premier EUR Thesaurierend	134.268	375	344,87	116.174	376	286,04	87.612	327	253,64
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	57.944	439	127,30	110.865	917	111,92	57.089	544	99,13
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	120,42	1	–	103,51	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	133.993	1.070	125,21	102.451	949	107,98	–	–	–
LM Klasse USD Ausschüttend (A)	8.963	66	135,65	8.649	73	118,00	9.339	91	103,12
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 38.644	95	408,84	\$ 37.093	104	358,09	\$ 33.113	119	278,54
Klasse A USD Ausschüttend (A)	4.889	12	408,54	9.624	27	357,83	9.060	33	278,34
Klasse A EUR Thesaurierend	1.808	3	577,58	2.958	6	485,31	1.469	4	385,75
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	26	–	321,46	20	–	251,30
Klasse B USD Ausschüttend (A)	–	–	–	42	–	120,88	–	–	–
Klasse C USD Thesaurierend	17.119	47	365,41	15.586	48	321,41	13.742	55	251,27
Klasse C USD Ausschüttend (A)	22.952	61	374,14	21.370	65	329,09	17.444	68	257,27
Klasse E USD Thesaurierend	19.169	45	421,63	18.472	50	371,80	18.769	64	291,41
Klasse E USD Ausschüttend (A)	1.296	3	421,78	1.260	3	371,92	1.067	4	291,51
Klasse F USD Thesaurierend	20.023	51	389,07	20.011	59	338,74	20.872	80	261,94
Klasse F USD Ausschüttend (A)	4.004	8	516,10	4.897	11	449,51	4.100	12	347,83
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1.597	5	334,30	1.390	5	290,70	1.480	7	224,94
Klasse X EUR Thesaurierend	18	–	449,29	16	–	374,84	12	–	296,11
Klasse Premier USD Thesaurierend	7.226	13	540,60	4.935	11	468,91	7.267	20	361,23
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	1.985	3	625,26	1.968	4	544,32	2.119	5	421,23
Klasse Premier EUR Thesaurierend	1.841	3	653,22	29.057	49	544,06	20.884	46	428,10
Klasse LM USD Thesaurierend	24.242	80	301,39	27.678	107	259,79	24.655	124	198,89
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	1.253	4	273,25	2.115	9	213,81
Klasse A (G) USD Thesaurierend	4.247	10	432,63	4.270	11	377,61	3.734	13	292,72
Klasse B (G) USD Thesaurierend	6	–	394,81	5	–	346,32	4	–	269,86
Klasse L (G) USD Thesaurierend	3.737	9	395,73	3.284	9	347,14	2.579	10	270,45
Klasse GA USD Thesaurierend	5.672	13	432,34	5.124	14	378,01	4.167	14	293,53
Klasse GA EUR Thesaurierend	485	1	599,31	426	1	502,92	368	1	398,98
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	633	1	597,52	563	1	501,43	453	1	397,87
Klasse GE USD Thesaurierend	157	–	390,09	139	–	343,64	108	–	268,85
Klasse GE EUR Thesaurierend	10	–	540,29	9	–	456,83	9	–	365,13
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 293.114	486	603,37	\$ 291.603	544	535,90	\$ 208.487	571	364,91
Klasse A USD Ausschüttend (A)	44.550	74	603,65	42.700	80	536,15	30.903	85	365,08
Klasse A EUR Thesaurierend	93.206	96	934,50	86.759	101	796,62	59.073	101	554,31
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.381	64	291,75	18.990	67	263,79	6.519	34	183,21
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1	–	138,97	1	–	118,33	–	–	–
Klasse B USD Thesaurierend	6	–	543,86	6	–	485,30	66	–	332,11
Klasse B USD Ausschüttend (A)	61	–	551,97	59	–	492,71	39	–	337,19
Klasse C USD Thesaurierend	27.408	50	543,85	27.399	56	485,46	21.984	66	332,22
Klasse C USD Ausschüttend (A)	11.686	21	552,07	12.261	25	492,80	9.309	28	337,25
Klasse E USD Thesaurierend	12.306	38	320,39	11.555	40	286,71	9.229	47	213,70
Klasse F USD Ausschüttend (A)	22	–	310,74	43	–	278,07	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	107.866	323	333,98	98.806	335	294,85	129.606	649	199,57
Klasse F USD Ausschüttend (A)	19.052	57	333,27	18.482	63	294,22	14.933	75	199,15
Klasse X USD Thesaurierend	29.134	78	374,22	44.931	136	330,19	36.363	163	223,43
Klasse X EUR Thesaurierend	7.045	24	282,13	5.031	19	238,85	1.169	7	165,08
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	3.390	12	268,33	9.787	38	240,87	1.803	10	166,19
Klasse X GBP Thesaurierend	10.557	21	399,31	14.261	32	351,17	7.294	24	249,48
Klasse Premier USD Thesaurierend	364.815	916	398,26	404.984	1.156	350,29	191.353	810	236,21
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	8.020	43	187,94	7.033	43	165,30	6.124	55	111,46
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	43.966	840	308,20	30.321	576	261,50	22.607	704	168,22
Klasse Premier EUR Thesaurierend	114.692	306	361,70	111.362	337	305,37	71.935	323	210,40
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	78.620	251	301,57	62.598	215	269,94	21.337	109	185,58
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	5.905	29	195,94	6.968	39	165,25	3.771	31	113,87
Klasse Premier GBP Thesaurierend	108.317	211	408,40	116.480	258	358,00	59.348	195	253,36
Klasse S USD Thesaurierend	268.463	1.052	255,16	239.721	1.069	224,20	197.273	1.306	151,03
Klasse S USD Ausschüttend (Q)	26.878	209	128,49	9.379	83	112,91	–	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend	201.271	641	302,62	112.184	407	255,24	15.490	83	175,64
Klasse LM USD Thesaurierend	70.694	188	375,15	61.484	188	327,89	80.119	365	219,73
Klasse LM EUR Thesaurierend	2.362	21	109,66	389	1	345,23	514	2	236,23
Klasse A (G) USD Thesaurierend	11.355	18	637,18	10.921	19	563,95	7.893	21	382,67
Klasse L (G) USD Thesaurierend	14.557	25	582,76	14.076	27	518,37	9.700	27	353,51
Klasse GA USD Thesaurierend	1.253	2	751,35	2.001	3	666,12	1.426	3	452,77
Klasse GA EUR Thesaurierend	28	–	924,14	25	–	786,38	17	–	546,16
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 52.949	196	270,16	\$ 59.251	238	248,53	\$ 59.419	295	201,50
Klasse A USD Ausschüttend (A)	12.819	47	270,33	17.024	68	248,68	16.442	82	201,63
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	3.196	27	191,83	3.724	32	179,11	4.700	47	148,15
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	63	–	125,08	61	–	119,89	48	–	101,44
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	575	24	172,04	836	37	162,31	984	51	135,16
Klasse A EUR Thesaurierend	7.612	17	420,18	7.945	20	371,22	6.874	21	307,57
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	579	3	176,33	673	4	165,29	581	4	136,82
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	14	–	119,57	11	–	98,97
Klasse A GBP Thesaurierend	84	–	203,02	145	1	186,23	138	1	158,44
Klasse A HKD Thesaurierend	197	10	161,59	175	9	149,72	201	13	121,73
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	26	2	181,49	29	2	170,64	18	1	141,68
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1.224	781	2,12	5.173	3.506	1,99	1.373	1.130	1,64
Klasse B USD Ausschüttend (A)	5	–	247,14	4	–	228,52	82	–	186,21
Klasse C USD Thesaurierend	5.939	23	257,85	6.422	27	238,39	6.110	31	194,26
Klasse C USD Ausschüttend (A)	8.649	35	247,16	9.010	39	228,51	8.523	46	186,21
Klasse E USD Thesaurierend	4.297	17	253,89	4.964	21	235,38	5.324	28	192,28
Klasse E USD Ausschüttend (A)	754	3	253,93	718	3	235,42	1.046	5	192,32
Klasse E EUR Thesaurierend	11	–	104,05	10	–	92,58	8	–	77,29
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	24	–	145,51	123	1	137,46	95	1	114,66
Klasse F USD Thesaurierend	7.812	25	307,67	8.560	30	281,40	8.708	38	226,80
Klasse F USD Ausschüttend (A)	933	3	307,88	512	2	281,60	1.498	7	226,96
Klasse X USD Thesaurierend	3.282	15	221,37	3.127	15	202,12	3.219	20	162,82
Klasse X USD Ausschüttend (A)	696	3	246,05	679	3	224,65	544	3	180,97
Klasse X EUR Thesaurierend	138	1	244,65	308	1	214,49	855	5	176,54
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	39	–	150,22	58	–	139,71	55	–	114,99
Klasse X GBP Thesaurierend	9.861	28	281,16	10.838	34	255,87	10.255	39	216,32
Klasse Premier USD Thesaurierend	4.418	12	372,02	4.629	14	338,89	20.680	76	272,04
Klasse Premier EUR Thesaurierend	2.792	6	419,60	2.437	6	366,91	2.505	8	301,00
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	90	1	120,14	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend	242	1	155,76	265	1	141,42	215	1	119,13
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	178	1	166,69	243	1	152,46	350	2	123,31
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	25.952	59	351,41	35.296	88	319,10	42.019	130	269,21
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	340	2	193,95	602	4	158,07
Klasse A (G) USD Thesaurierend	15.613	54	286,59	16.350	62	262,78	14.718	69	212,32
Klasse B (G) USD Thesaurierend	8	–	262,18	7	–	241,66	6	–	196,19
Klasse L (G) USD Thesaurierend	5.395	21	262,10	7.012	29	241,53	6.310	32	196,13
Klasse GA EUR Thesaurierend	168	–	445,73	155	–	392,74	125	–	324,64
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	76	–	444,06	70	–	391,27	59	–	323,42

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	Gesamt-NIWW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil	Gesamt-NIWW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil	Gesamt-NIWW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund (Fortsetzung)									
Klasse GE USD Thesaurierend	\$ 78	–	325,53	\$ 72	–	301,10	\$ 59	–	245,41
Klasse GE EUR Thesaurierend	45	–	401,48	41	–	356,43	34	–	296,85
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 15.090	82	184,95	\$ 12.725	79	160,24	\$ 13.397	97	138,55
Klasse A USD Ausschüttend (A)	113	1	140,62	99	1	122,86	86	1	107,55
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1.959	20	98,74	1.499	17	89,07	2.262	28	80,14
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1	–	123,31	1	–	109,31	113	1	97,14
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1.436	10	139,74	1.251	10	121,80	1.092	10	106,31
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	729	14	86,79	744	14	79,19	859	18	72,55
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	53	4	92,87	65	5	85,94	60	5	79,42
Klasse A EUR Thesaurierend	212	1	176,24	160	1	146,52	141	1	129,46
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	537	4	134,12	493	4	118,29	502	5	104,45
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	22	–	93,99	18	–	84,80	294	4	76,94
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	228	18	98,75	122	11	89,70	151	15	80,92
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	323	478	0,91	223	357	0,84	599	1.052	0,77
Klasse C USD Thesaurierend	973	6	173,65	834	6	151,10	896	7	131,30
Klasse C USD Ausschüttend (A)	106	1	140,09	121	1	122,38	106	1	107,11
Klasse C USD Ausschüttend (Q)	80	1	129,50	84	1	112,99	73	1	98,62
Klasse F USD Thesaurierend	18.371	103	178,17	17.286	113	153,44	17.713	134	131,88
Klasse F EUR Thesaurierend	75	–	187,39	64	–	154,89	55	–	136,03
Klasse F EUR Ausschüttend (A)	67	–	148,39	90	1	124,35	79	1	111,26
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	61	1	115,82	57	1	103,79	50	1	93,55
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 31.949	176	181,53	\$ 50.323	297	169,20	\$ 47.722	328	145,55
Klasse A USD Ausschüttend (A)	5.105	18	284,60	9.959	38	265,27	10.477	46	228,19
Klasse A EUR Thesaurierend	331	3	122,45	5.603	47	109,50	4.993	49	96,27
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	11.192	46	233,68	18.698	78	221,81	21.414	104	194,79
Klasse A SEK Thesaurierend	58.942	3.618	175,40	60.611	3.998	157,16	56.766	4.360	136,29
Klasse F USD Thesaurierend	1.145	6	186,86	3.388	20	173,12	5.947	40	148,03
Klasse X USD Thesaurierend	947	6	156,39	4.617	32	144,80	12.869	104	123,82
Klasse X USD Ausschüttend (A)	198	1	301,05	343	1	278,75	857	4	238,35
Klasse X EUR Thesaurierend	992	7	142,15	7.021	51	126,38	708	6	110,40
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	4.776	19	247,78	7.064	28	233,57	2.811	13	203,85
Klasse X GBP Thesaurierend	105.671	246	341,70	277.252	696	315,54	478.725	1.405	283,28
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	945	5	157,36	852	5	146,50	2.318	15	126,11
Klasse Premier USD Thesaurierend	20.314	119	170,08	97.282	620	157,03	94.620	707	133,80
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	6.082	20	304,10	6.015	21	281,62	33.164	138	240,49
Klasse Premier EUR Thesaurierend	1	–	131,34	–	–	116,19	1	–	101,11
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.997	8	256,13	2.870	11	240,74	5.531	25	209,43
Klasse Premier GBP Thesaurierend	36.868	79	372,48	22.333	52	342,96	11.173	30	306,82
Klasse P2 USD Thesaurierend	298.796	1.359	219,84	500.641	2.472	202,56	532.065	3.089	172,25
Klasse P2 EUR Thesaurierend	95.543	508	181,42	80.725	466	160,45	52.170	354	139,45
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	4.555	29	151,92	1.893	12	142,35	1.699	13	123,63
Klasse P2 GBP Thesaurierend	102.810	447	182,77	92.089	435	167,88	145.409	807	149,85
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	48.538	232	166,39	60.674	312	154,07	72.678	458	132,01
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	27.904	125	177,99	16.831	81	164,24	10.539	59	147,32
Klasse LM EUR Thesaurierend	55.755	373	144,21	38.425	280	127,04	35.323	304	109,96
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund II									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 991	5	197,85	\$ 861	5	172,21	\$ 686	5	137,15
Klasse C USD Thesaurierend	1	–	100,07	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	1	–	100,06	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	1	–	100,37	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	26.334	125	211,49	15.857	87	182,25	12.493	87	143,70
Klasse P2 USD Thesaurierend	1	–	100,48	–	–	–	–	–	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund A									
Klasse A USD Thesaurierend	€ 10.224	762	13,92	€ 8.869	754	12,72	€ 22.713	1.980	12,13
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	44.262	2.518	18,23	32.739	2.248	15,74	54.425	3.812	15,10
Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	37.806	3.389	11,57	34.959	3.575	10,57	44.093	4.340	10,75
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	11	1	10,46	–	–	9,96	–	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1.984	134	15,37	2.347	179	14,17	2.915	226	13,62
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.943	296	10,96	2.402	399	10,00	2.473	382	10,18
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	11.127	7.574	11,12	26.118	19.835	10,26	23.313	16.311	10,51
Klasse A EUR Thesaurierend	144.310	8.638	16,71	124.782	8.513	14,66	145.537	10.186	14,29
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	3.582	274	13,10	3.123	265	11,78	6.339	554	11,43
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1.178	108	10,86	428	45	9,60	418	45	9,36
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	2.886	216	13,34	3.614	297	12,18	3.899	315	12,36
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	4.560	5.711	1,12	4.622	6.557	1,03	4.235	5.789	1,04
Klasse C USD Thesaurierend	783	61	13,22	1.311	117	12,14	3.347	304	11,64
Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	1.110	68	17,03	945	69	14,79	1.366	101	14,27
Klasse E USD Thesaurierend	3.853	261	15,32	4.305	330	14,11	6.399	499	13,56
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	1.221	91	13,95	1.123	100	12,15	2.326	210	11,74
Klasse E EUR Thesaurierend	965	85	11,29	90	9	9,98	–	–	–
Klasse E EUR Ausschüttend (A)	171	15	11,28	1	–	9,99	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	3.675	264	14,43	4.669	385	13,12	4.659	397	12,43
Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	8.286	465	18,50	4.774	325	15,88	9.258	646	15,15
Klasse X USD Thesaurierend	460	34	14,20	251	21	12,87	1.495	130	12,17
Klasse X USD Ausschüttend (A)	178	13	13,90	364	31	12,80	501	43	12,22
Klasse X EUR Thesaurierend	26.936	1.549	17,39	23.612	1.562	15,12	57.566	3.942	14,60
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	1.529	112	13,60	1.783	147	12,12	10.121	869	11,65
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	2.716	167	13,43	1.800	125	12,34	2.493	176	12,45
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	82	7	9,98	–	–	–	410	34	10,52
Klasse Premier USD Thesaurierend	50.977	2.840	18,62	38.426	2.467	16,84	74.451	4.958	15,88
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	935	212	26,90	1.196	290	22,13	2.798	775	20,00
Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	46.579	5.376	13,00	42.027	5.220	11,81	46.777	5.861	11,52
Klasse Premier EUR Thesaurierend	189.442	6.719	28,19	333.314	13.624	24,46	432.296	18.330	23,58
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	7.710	531	14,53	7.864	609	12,91	4.026	325	12,40
Klasse Premier GBP Thesaurierend	117	5	18,65	119	6	16,81	405	21	16,65
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	3.195	108	24,31	4.434	174	21,88	14.897	618	21,18
Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	14.642	786	15,37	60.352	3.661	14,12	76.882	4.746	14,25
Klasse S EUR Thesaurierend	104.736	8.890	11,78	46.156	4.524	10,20	–	–	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 13.476	127	106,04	\$ 19.511	203	96,21	\$ 27.166	280	96,98
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	30.885	348	88,77	44.714	522	85,66	61.518	674	91,28
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	31.440	343	91,71	45.099	517	87,17	61.812	670	92,22
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	5.314	105	81,46	5.774	111	79,69	8.133	139	86,78
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1.185	107	81,15	1.489	133	80,49	1.325	104	88,26
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	159	2	88,33	99	1	80,98	67	1	85,09
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	5.603	68	79,67	7.044	83	78,50	8.022	89	85,54
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	4.330	42	82,53	4.675	46	80,15	5.016	48	86,10
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	528	46	89,40	702	63	86,86	1.385	117	92,80
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	42.374	69.310	0,83	50.922	84.124	0,81	63.459	96.802	0,88
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1.134	12	94,39	1.120	13	89,03	17.277	185	93,47
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	83	1	83,29	275	3	79,26	376	4	84,08
Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	622	7	86,94	813	9	83,64	2.323	24	90,22
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	223	2	86,54	213	2	82,10	651	6	87,29
Klasse Premier USD Thesaurierend	10.914	114	96,12	1.960	23	86,30	2.352	27	86,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIWI/Anteil	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIWI/Anteil	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIWI/Anteil
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	\$ 86.588	958	90,37	\$ 61.976	718	86,28	\$ 59.725	657	90,93
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	573	6	89,97	27.600	298	85,67	32.976	343	90,86
Klasse S USD Thesaurierend	1.787	17	105,63	10.229	108	94,68	4.556	48	94,25
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	4.379	40	108,31	4.918	48	101,66	–	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend	6.636	58	110,62	3.218	31	95,14	8.777	86	96,85
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	242	2	107,08	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	121	1	108,59	8	–	97,80	67	1	97,29
Klasse S GBP Thesaurierend	3.438	26	103,29	3.453	30	92,34	3.127	27	96,41
Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	615	4	110,61	315	2	99,87	–	–	–
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	1.115	8	106,79	219	2	100,84	–	–	–
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	3.141	26	97,65	643	6	91,32	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	25.888	230	112,32	29.372	292	100,48	28.020	281	99,82
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	4.356	47	92,38	5.448	62	87,89	7.918	86	92,31
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 13	–	131,42	\$ 11	–	112,17	\$ –	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	13	14	1,28	11	14	1,11	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	13	–	133,34	11	–	112,65	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	6.633	50	134,01	5.585	50	112,82	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	13	–	130,30	11	–	111,80	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	14	–	132,58	12	–	112,40	–	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 161.633	514	314,38	\$ 141.806	466	304,22	\$ 136.340	481	283,21
Klasse A USD Ausschüttend (A)	35.357	37	954,75	28.296	31	923,89	30.404	35	860,08
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	4.813	34	228,46	5.382	37	224,42	5.856	41	213,77
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	1.860	67	201,14	3.238	117	199,58	2.411	88	190,89
Klasse A EUR Thesaurierend	84.890	207	395,98	29.710	75	368,07	32.297	87	350,21
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	17.686	77	222,16	8.088	34	218,83	14.136	64	208,42
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	228	1	168,92	184	1	166,42	172	1	158,47
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	125	1	188,59	143	1	183,61	460	2	172,42
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	733	1	394,53	595	1	380,55	727	2	371,81
Klasse A SGD Thesaurierend	106	5	216,18	64	3	213,92	80	4	204,46
Klasse A SGD Ausschüttend (Abgesichert)	4.633	2.021	3,10	5.678	2.559	2,99	10.567	5.109	2,79
Klasse B USD Thesaurierend	21.731	10.263	2,86	36.958	17.608	2,82	26.220	13.193	2,68
Klasse B USD Ausschüttend (A)	17	–	321,46	17	–	312,65	119	–	292,49
Klasse C USD Thesaurierend	14	–	859,69	14	–	836,05	21	–	782,27
Klasse C USD Ausschüttend (A)	14.117	44	322,01	9.883	32	313,17	11.432	39	293,00
Klasse C USD Ausschüttend (A)	4.425	5	854,11	5.516	7	830,66	5.195	7	777,17
Klasse E USD Thesaurierend	22.026	77	286,25	10.942	39	279,09	9.939	38	261,78
Klasse E USD Ausschüttend (A)	845	3	286,21	636	2	279,05	502	2	261,74
Klasse E EUR Thesaurierend	7.400	18	395,73	2.933	7	370,44	1.582	4	355,11
Klasse E EUR Ausschüttend (Abgesichert)	2.961	16	174,79	2.886	15	173,49	1.111	6	166,43
Klasse F USD Thesaurierend	13.946	40	346,02	11.899	36	332,82	15.873	52	307,98
Klasse F USD Ausschüttend (A)	602	2	346,39	295	1	333,18	267	1	308,31
Klasse R USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Klasse R EUR Thesaurierend	334	1	314,01	321	1	290,18	302	1	274,66
Klasse X USD Thesaurierend	40.309	131	307,76	57.413	194	295,58	47.508	174	273,10
Klasse X USD Ausschüttend (A)	3.629	17	213,37	2.193	6	204,93	1.177	6	189,35
Klasse X EUR Thesaurierend	44.340	211	202,54	10.914	54	186,75	5.887	32	176,23
Klasse X EUR Ausschüttend (Abgesichert)	28.417	137	200,55	13.486	64	196,18	11.488	59	185,38
Klasse X GBP Thesaurierend	42.328	85	397,13	36.189	75	380,13	39.715	90	368,64
Klasse X GBP Ausschüttend (A)	2.206	5	363,54	2.614	6	348,01	3.082	8	337,47
Klasse Premier USD Thesaurierend	311.254	761	408,75	170.380	436	391,20	220.211	611	360,19
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	1.279	36	208,82	5.565	143	194,04	6.630	203	170,82
Klasse Premier EUR Thesaurierend	63.241	107	569,60	39.297	69	523,29	46.669	90	492,39
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Abgesichert)	15.759	69	219,06	13.882	60	213,51	5.193	24	200,98
Klasse Premier GBP Thesaurierend	25.295	53	380,42	30.462	67	362,88	44.274	105	350,66
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	5.795	142	164,72	8.011	203	157,42	3.681	114	144,10
FTGF Royce US Smaller Companies Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 30.267	122	248,21	\$ 34.706	135	256,17	\$ 31.063	134	231,96
Klasse A USD Ausschüttend (A)	7.812	19	419,92	9.278	21	433,55	9.540	24	392,74
Klasse A EUR Thesaurierend	5.769	13	417,24	1.340	3	413,38	2.035	5	382,78
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	320	2	164,23	188	1	172,53	98	1	159,80
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	242	1	295,44	229	1	292,77	124	–	271,21
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	–	–	–	59	–	405,71	54	–	385,69
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	164,37	3	–	173,53	2	–	161,28
Klasse C USD Thesaurierend	3.046	13	238,40	3.180	13	247,28	2.964	13	225,03
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2.056	5	376,43	2.725	7	390,60	2.765	8	355,62
Klasse E USD Thesaurierend	993	4	253,91	866	3	264,13	721	3	241,07
Klasse E USD Ausschüttend (A)	–	–	–	8	–	155,41	7	–	141,84
Klasse E EUR Thesaurierend	143	1	170,50	9	–	170,42	9	–	158,95
Klasse F USD Thesaurierend	14.838	48	311,18	15.526	49	319,35	11.194	39	287,56
Klasse F USD Ausschüttend (A)	690	2	332,88	546	2	341,62	532	2	307,61
Klasse R USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	109	1	168,67
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	19	–	231,43	53	–	208,08
Klasse X USD Ausschüttend (A)	29	–	103,78	2	–	106,26	1	–	95,46
Klasse Premier USD Thesaurierend	506	1	344,97	10.847	31	352,30	600	2	315,65
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	13.010	54	239,56	12.258	50	245,06	12.361	56	219,68
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	1.781	5	305,31	2.049	5	311,23	1.473	4	292,99
Klasse P2 USD Thesaurierend	1	–	94,94	–	–	–	–	–	–
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	327	1	248,09	702	3	225,37
Klasse A (G) USD Thesaurierend	718	3	281,62	941	3	289,01	941	4	260,24
Klasse L (G) USD Thesaurierend	631	2	257,41	829	3	265,50	750	3	240,27
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 8	–	83,36	\$ 9	–	85,46	\$ 8	–	83,66
Klasse X USD Thesaurierend	9	–	85,52	9	–	86,92	9	–	84,44
Klasse X GBP Thesaurierend	2	–	95,25	6	–	96,54	14	–	98,60
Klasse Premier USD Thesaurierend	4.303	50	86,39	4.362	50	87,60	4.223	50	84,81
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 1.708	12	143,40
Klasse A USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	2.930	13	229,91
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	3.235	38	84,93
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	2.539	45	83,03
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	–	–	–	–	–	–	173	16	74,97
Klasse A EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	134	1	137,11
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	1.518	139	85,63
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	32	48	0,91
Klasse B USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	13	–	223,94
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	100	1	98,15
Klasse C USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	1.236	6	222,72
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	14	–	133,58
Klasse E USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	10	–	94,16
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	298	2	128,31
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	35	1	138,86
Klasse GA USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	6.520	45	143,98
Klasse GA EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	124	1	173,18
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	2	–	143,83
Klasse GE USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	469	4	131,10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2025			29. Februar 2024			28. Februar 2023		
	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 Asia Long-Term Unconstrained Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 88	1	115,41
Klasse M GBP Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	1.692	85	16,64
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	120,20
Klasse M USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	320	26	12,52
Klasse M EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	62	4	15,35
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.362	15	89,46
Klasse Premier GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	13	–	102,96
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1.078	6	190,60	\$ 4.955	24	203,06	\$ 4.707	29	163,21
Klasse A EUR Thesaurierend	2.567	12	203,20	5.474	24	207,83	6.205	34	170,77
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	6.851	76	86,49	16.784	165	94,05	13.539	165	77,46
Klasse C USD Thesaurierend	10	–	80,33	192	2	86,03	181	3	69,49
Klasse E USD Thesaurierend	882	7	123,90	2.144	16	133,00	2.560	24	107,70
Klasse F USD Thesaurierend	75	1	83,08	155	2	87,97	215	3	70,28
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	114	1	100,06	91	1	79,83
Klasse X EUR Thesaurierend	89	–	216,99	247	1	220,00	192	1	179,33
Klasse X GBP Thesaurierend	744	3	213,04	1.557	6	224,16	1.283	6	187,66
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1.501	7	177,69	3.054	13	189,03	2.167	12	152,41
Klasse Premier USD Thesaurierend	1.502	7	209,38	14.030	64	220,60	14.049	80	175,37
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	23	–	131,95	433	3	106,02
Klasse P2 USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	5.827	63	92,64
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23	–	91,90	58.905	553	98,52	73.491	869	79,99
Klasse P2 GBP Thesaurierend	6.174	21	228,37	16.387	54	239,25	16.109	67	198,75
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^{Δ&}									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	\$ –	–	–	\$ 1	–	102,33	\$ –	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	4.472	54	83,34	5.748	66	87,21
Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	448	7	95,96	454	7	97,11
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	454	5	85,20	457	5	91,10
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	43	71	0,82	45	70	0,86
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	42	–	96,98	1.014	10	101,21
Klasse D USD Thesaurierend	–	–	–	4.158	36	116,92	5.511	48	115,20
Klasse D AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	21	–	90,80	375	6	96,94
Klasse D CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	1	–	92,05	1	–	98,76
Klasse D HKD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	1	–	98,04	1	–	102,55
Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	227	325	0,94	307	414	1,00
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	5.843	45	128,70	5.801	46	126,36
Klasse X AUD Thesaurierend	–	–	–	199	2	135,41	312	4	128,43
Klasse P1 GBP Thesaurierend	–	–	–	500	3	143,09	487	3	146,47
Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	491	4	98,12	487	4	106,24
Klasse LM AUD Thesaurierend	–	–	–	4.243	47	139,35	4.121	47	130,72
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 2.561	27	94,99	\$ 4.368	49	89,74	\$ 4.789	54	88,85
Klasse E USD Thesaurierend	214	2	104,07	203	2	99,06	352	4	98,83
Klasse F USD Thesaurierend	11.941	98	121,78	14.174	124	114,36	14.837	132	112,56
Klasse X USD Thesaurierend	2	–	104,52	2	–	98,01	2	–	96,38
Klasse Premier USD Thesaurierend	6.160	57	107,28	1.886	19	100,24	3.812	39	98,17
Klasse P2 USD Thesaurierend	129	1	130,92	233	2	122,08	347	3	119,33
Klasse P2 EUR Thesaurierend	10.946	89	118,33	10.781	94	105,90	10.563	94	105,77
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	€ –	–	–	€ 31	–	96,69	€ 26	–	80,63
Klasse A EUR Thesaurierend	1.275	8	150,39	1.873	12	160,37	1.770	13	136,40
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	30	–	94,98	26	–	79,81
Klasse X EUR Thesaurierend	571	4	157,66	683	4	166,86	528	4	140,86
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	768	33	123,89	1.342	76	97,67
Klasse Premier EUR Thesaurierend	8	–	161,19	991	6	169,99	850	6	143,00
Klasse P1 USD Thesaurierend	203	2	120,94	1	–	132,29	1	–	108,31
Klasse P1 EUR Thesaurierend	9.801	69	142,18	84.273	564	149,33	76.234	609	125,11
Klasse P1 GBP Thesaurierend	71.158	733	80,08	100.228	982	87,35	108.320	1.267	75,17
Klasse P2 EUR Thesaurierend	1	–	107,31	–	–	–	–	–	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 104	1	105,01	\$ 97	1	97,47	\$ –	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend	2	–	123,66	1	–	113,48	–	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1.129	8	106,87	851	7	99,05	–	–	–
Klasse P1 USD Thesaurierend	5.093	47	108,37	4.640	47	98,72	–	–	–
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	99	1	104,66	96	1	97,23	–	–	–
Klasse P1 GBP Thesaurierend	1.068	7	125,27	2	–	113,84	–	–	–
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	390	3	107,06	499	4	98,16	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend	7.651	59	103,90	–	–	–	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^Δ									
Klasse A EUR Thesaurierend	€ 8.493	77	110,01	€ 10.087	97	104,08	€ 98	1	98,13
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	43.301	409	105,99	44.990	432	104,14	5.022	51	98,18
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus	–	–	–	–	–	–	98	1	98,13
Klasse D EUR Thesaurierend	811	7	108,74	1.157	11	103,46	98	1	98,08
Klasse D EUR Ausschüttend (A)	214	2	105,34	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	499	4	110,91	491	5	104,52	9.474	97	98,17
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	29.633	278	106,43	30.769	294	104,60	21.739	221	98,22
Franklin Responsible Income 2029 Fund^{Δα}									
Klasse A EUR Thesaurierend	€ 7.630	72	105,58	€ –	–	–	€ –	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	26.343	250	105,58	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	5.173	49	105,98	–	–	–	–	–	–

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 £.

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

α Mit Wirkung vom 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund^Δ den Handel auf.

β Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

γ Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^Δ den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^Δ den Handel ein.

λ Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^Δ den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^Δ den Handel ein.

θ Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund^Δ in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund^Δ umbenannt.

Ω Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^Δ den Handel ein.

Δ 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 ^Δ	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 71.235	\$ 51.509	\$ 5.899	\$ 7.578	\$ 24.210	\$ 47.157	€ 409	€ 2.261
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	1	11	36	5	14
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	-40	-1	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	2	-4.578	-2.958	-46.581	-103.623	-4.605	-12.108
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	6.613	1.756	57.831	96.548	4.592	16.188
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	71.235	51.511	7.934	6.377	35.431	40.117	401	6.355
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	8.201	5.621	906	1.152	3.428	5.500	16	35
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	366	254	112	139	444	761	14	77
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	111	113	220	269	1	2
Rechtskosten	37	28	6	5	30	36	1	4
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	21	23	42	46	42	46	12	28
Druckkosten	36	10	5	–	32	–	2	5
Zinsaufwendungen	–	–	–	1	5	27	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	15	11	2	2	7	13	–	2
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	255	126	62	38	207	191	24	40
Aufwendungen gesamt	8.931	6.073	1.246	1.496	4.415	6.843	70	193
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-37	-64	-27	-3	-16	–
Gesamtnettoaufwendungen	8.931	6.073	1.209	1.432	4.388	6.840	54	193
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	62.304	45.438	6.725	4.945	31.043	33.277	347	6.162
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-48.373	-36.140	-1.886	-1.973	-2.322	-2.990	-20	-18
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	13.931	9.298	4.839	2.972	28.721	30.287	327	6.144
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	7	-2	-12	-86	4	5
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 13.931	\$ 9.298	\$ 4.846	\$ 2.970	\$ 28.709	\$ 30.201	€ 331	€ 6.149
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^Δ	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 3.275	\$ 3.691	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	1	2	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-2	-1	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-1.556	-7.210	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	2.604	7.415	–	–	–	–	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	4.322	3.897	–	–	–	–	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	429	468	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	44	46	–	–	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	60	65	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	2	2	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	28	30	–	–	–	–	–	–
Druckkosten	2	3	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	1	–	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	78	57	–	–	–	–	–	–
Aufwendungen gesamt	643	672	–	–	–	–	–	–
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-58	-43	–	–	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	585	629	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	3.737	3.268	–	–	–	–	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-2.386	-2.600	–	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	1.351	668	–	–	–	–	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-2	10	–	–	–	–	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.349	\$ 678	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^A		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^A		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^A	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ -	\$ -	\$ 13.498	\$ 13.206	\$ 7.874	\$ 8.798	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	9	14	-	-	-	-	-	-
-	-	56	7	-12	1	-	-	-	-
-	18	-	-	-	-	5	-	-	-
-	-	-14.217	-21.878	-602	-9.725	-	-	-	-1
-	-	12.011	23.817	2.359	10.243	-	-	-	1
-	18	11.357	15.166	9.619	9.317	5	-	-	-
-	-	1.309	1.139	719	755	-	-	-	-
-	-	200	179	83	89	-	-	-	-
-	-	92	74	85	85	-	-	-	-
-	-	8	7	3	4	-	-	-	-
-	-	42	46	28	30	-	-	-	-
-	-	8	-	4	-	-	-	-	-
-	-	-	3	-	1	-	-	-	-
-	-	3	3	1	1	-	-	-	-
-	18	-	-	-	-	5	-	-	-
-	-	150	72	79	41	-	-	-	-
-	18	1.812	1.523	1.002	1.006	5	-	-	-
-	-	-22	-4	-48	-7	-	-	-	-
-	18	1.790	1.519	954	999	5	-	-	-
-	-	9.567	13.647	8.665	8.318	-	-	-	-
-	-	-6.694	-5.048	-3.850	-4.062	-	-	-	-
-	-	2.873	8.599	4.815	4.256	-	-	-	-
-	-	-99	-129	-11	5	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ 2.774	\$ 8.470	\$ 4.804	\$ 4.261	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^A		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^A		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^A	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ 9.875	\$ 17.114	\$ 12.367	\$ 13.849	\$ 3.720	\$ 5.375	\$ 1.222	\$ 1.345	€ -	€ -
1	2	17	23	4	6	1	2	-	-
-82	-1.227	-272	-2	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-10.690	-39.035	-247	-7.417	-5.520	-7.922	-804	-4.996	-	-
11.317	36.019	11.587	34.383	1.223	10.643	1.585	5.288	-	-
10.421	12.873	23.452	40.836	-573	8.102	2.004	1.639	-	-
1.891	2.796	1.542	1.904	126	239	5	20	-	-
193	308	324	379	90	117	30	33	-	-
174	161	131	160	2	2	1	3	-	-
11	14	16	16	5	5	1	2	-	-
42	46	28	31	28	31	27	31	-	-
11	1	16	22	5	7	1	2	-	-
1	1	1	5	-	1	-	-	-	-
3	5	5	6	1	2	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
145	105	142	132	72	91	33	34	-	-
2.471	3.437	2.205	2.655	329	495	98	125	-	-
-1	-	-15	-2	-3	-10	-	-	-	-
2.470	3.437	2.190	2.653	326	485	98	125	-	-
7.951	9.436	21.262	38.183	-899	7.617	1.906	1.514	-	-
-5.535	-6.491	-9.363	-9.370	-	-	-	-	-	-
2.416	2.945	11.899	28.813	-899	7.617	1.906	1.514	-	-
-295	-442	8	22	-33	-49	-	-1	-	-
\$ 2.121	\$ 2.503	\$ 11.907	\$ 28.835	\$ -932	\$ 7.568	\$ 1.906	\$ 1.513	€ -	€ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^Δ		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund ^Δ		FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^Δ		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^Δ	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 39.116	\$ 100.114	\$ 31.534	\$ 24.593	\$ 38.866	\$ 39.224	\$ 43.384	\$ 40.198
Zinsen (Erläuterung 2)	25	53	7	6	15	1	1	7
Ausgleich (Erläuterung 2)	-27	-523	–	–	3	12	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-27.598	-187.391	-17.768	-11.557	-68.156	-18.167	-16.223	-28.926
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	3.819	235.632	11.294	20.147	83.939	13.059	52.394	17.340
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	15.335	147.885	25.067	33.189	54.667	34.129	79.556	28.619
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	7.655	19.179	381	320	378	700	183	179
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	473	1.170	323	239	422	408	952	864
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	633	1.444	–	–	6	10	–	–
Rechtskosten	27	28	11	9	18	66	38	35
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	10	46	28	31	42	46	28	30
Druckkosten	–	–	14	16	20	–	37	50
Zinsaufwendungen	10	32	2	–	15	1	1	8
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	8	20	5	3	6	6	14	13
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	122	58	101	78	122	50	197	167
Aufwendungen gesamt	8.938	21.977	865	696	1.029	1.287	1.450	1.346
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-74	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	8.864	21.977	865	696	1.029	1.287	1.450	1.346
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	6.471	125.908	24.202	32.493	53.638	32.842	78.106	27.273
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-10.398	-22.344	-1.718	-1.343	-870	-962	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	-3.927	103.564	22.484	31.150	52.768	31.880	78.106	27.273
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-457	-4.103	-68	-71	-118	17	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -4.384	\$ 99.461	\$ 22.416	\$ 31.079	\$ 52.650	\$ 31.897	\$ 78.106	\$ 27.273

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{ΔΔ}	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 9.941	\$ 21.603	\$ 2.722	\$ 2.106	\$ 12.364	\$ 12.627	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	1	1	–	1	1	1	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-16	–	–	7	-1	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	241	-29.812	-409	248	-12.553	-31.650	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-4.345	24.190	-604	999	-3.233	26.247	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	5.822	15.982	1.709	3.361	-3.422	7.225	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1.210	2.363	186	97	1.212	1.318	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	116	258	34	24	168	166	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	6	7	14	2	5	10	–	–
Rechtskosten	7	15	1	–	7	6	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	28	31	28	31	28	31	–	–
Druckkosten	13	–	1	1	7	10	–	–
Zinsaufwendungen	3	2	–	1	2	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	1	5	–	–	2	2	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	105	99	44	41	96	71	–	–
Aufwendungen gesamt	1.489	2.780	308	197	1.527	1.614	–	–
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-1	–	-56	-59	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	1.488	2.780	252	138	1.527	1.614	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	4.334	13.202	1.457	3.223	-4.949	5.611	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-263	-1.543	-1.017	-22	-94	-186	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	4.071	11.659	440	3.201	-5.043	5.425	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-206	-980	-5	–	-11	-132	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 3.865	\$ 10.679	\$ 435	\$ 3.201	\$ -5.054	\$ 5.293	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{ΔΩ}		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^Δ		FTGF ClearBridge US Value Fund [§]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 852	\$ 1.062	\$ 1.754	\$ 536	\$ –	\$ 7	\$ 25.014	\$ 20.597
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	1
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	11	-16
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken ge- haltenen Finanzinstrumenten	6	-499	482	877	–	-109	260.411	30.591
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-397	550	-294	426	–	-63	-86.970	100.238
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	461	1.113	1.942	1.839	–	-165	198.466	151.411
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	46	55	70	21	–	1	10.358	7.868
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	15	17	33	10	–	–	1.109	763
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	1.257	677
Rechtskosten	6	1	1	–	–	–	38	29
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	21	21	19	–	–	21	23
Druckkosten	1	1	1	–	–	–	34	39
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	13	6
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	15	11
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	20	45	21	7	–	–	308	205
Aufwendungen gesamt	88	140	147	57	–	1	13.153	9.621
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-58	-70	-24	-20	–	–	-226	–
Gesamtnettoaufwendungen	30	70	123	37	–	1	12.927	9.621
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	431	1.043	1.819	1.802	–	-166	185.539	141.790
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-11	-14	–	–	–	–	-138	-153
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	420	1.029	1.819	1.802	–	-166	185.401	141.637
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	8	-13	-1	–	–	-2	-6.559	-5.445
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rück- kaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 428	\$ 1.016	\$ 1.818	\$ 1.802	\$ –	\$ -168	\$ 178.842	\$ 136.192

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund [§]		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund ^Δ		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^{Δ*}	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenden- und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 15.534	\$ 21.822	\$ 251	\$ 174	€ 25.379	€ 30.153	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	1	–	–	–	46	139	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-1	-97	–	–	-10	-138	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	2
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken ge- haltenen Finanzinstrumenten	127.425	-28.473	3.546	362	18.526	-10.859	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-29.739	242.843	113	3.143	78.592	24.626	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	113.220	236.095	3.910	3.679	122.533	43.921	–	2
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	6.419	8.141	159	100	7.452	9.203	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	999	1.194	25	17	635	744	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.271	1.906	3	3	889	1.104	–	–
Rechtskosten	47	51	1	–	29	32	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	28	31	13	15	26	27	–	–
Druckkosten	45	77	1	1	25	45	–	–
Zinsaufwendungen	23	38	–	–	1	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	14	20	–	–	9	13	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	2
Sonstige Aufwendungen	302	381	29	31	233	231	–	–
Aufwendungen gesamt	9.148	11.839	231	167	9.299	11.399	–	2
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-217	-96	-33	-43	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	8.931	11.743	198	124	9.299	11.399	–	2
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	104.289	224.352	3.712	3.555	113.234	32.522	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-113	-130	–	–	-5.284	-6.882	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	104.176	224.222	3.712	3.555	107.950	25.640	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-3.983	-5.738	-41	-28	-4.194	-4.291	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rück- kaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 100.193	\$ 218.484	\$ 3.671	\$ 3.527	€ 103.756	€ 21.349	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason US Equity Fund ^A		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund ^A		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund ^A		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund ^A	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ 750	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	142	205	–	–	–	2
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-1	1	–	-2.395	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	1	-1	–	2.918	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	–	142	205	–	1.273	–	2
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	115	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	6	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	17	–	–
Rechtskosten	–	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	10	–	–
Druckkosten	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	142	205	–	–	–	2
Sonstige Aufwendungen	–	–	–	–	–	34	–	–
Aufwendungen gesamt	–	–	142	205	–	182	–	2
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	-41	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	142	205	–	141	–	2
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	–	–	–	1.132	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	-324	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	–	–	–	808	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	–	–	–	4	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ 812	\$ –	\$ –

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie EURpean Absolute Alpha Fund ^A		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund ^A		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund ^A		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund ^A	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024	28. Februar 2025	29. Februar 2024
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 786	\$ 1.447
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	22	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	18.803	-16.931
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	-21.045	40.823
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	22	–	–	–	–	-1.456	25.339
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	601	930
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	65	114
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	99	110
Rechtskosten	–	–	–	–	–	–	4	5
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	21	23
Druckkosten	–	–	–	–	–	–	3	6
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	1
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	1	2
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	22	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	–	–	–	–	54	63
Aufwendungen gesamt	–	22	–	–	–	–	848	1.254
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	-46	-27
Gesamtnettoaufwendungen	–	22	–	–	–	–	802	1.227
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	–	–	–	–	-2.258	24.112
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	–	–	–	–	-2.258	24.112
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	–	–	–	–	-68	-99
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -2.326	\$ 24.013

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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^	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 4	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	12	-	-	-	-	-	-
-	-30	-	-	-	-	-	-414	-	-
-	30	-	-	-	-	-	565	-	-
-	-	3	12	-	-	-	155	-	-
-	-	-	-	-	-	-	4	-	-
-	-	-	-	-	-	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	6	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	12	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	11	-	-
-	-	3	12	-	-	-	23	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-17	-	-
-	-	3	12	-	-	-	6	-	-
-	-	-	-	-	-	-	149	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-23	-	-
-	-	-	-	-	-	-	126	-	-
-	-	-	-	-	-	-	1	-	-
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	¥ -	¥ -	\$ -	\$ 127	\$ -	\$ -
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^δ		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^		FTGF Martin Currie Improving Society Fund^		Franklin Responsible Income 2028 Fund^	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ 383	\$ 1.328	\$ 680	\$ 703	€ 1.712	€ 2.344	\$ 96	\$ 32	€ 3.560	€ 3.591
-	-	-	-	3	7	1	-	2	6
-	-	-	-	-	-	-	-	-73	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-2.901	-175	-2.865	-1.652	-8.893	-6.961	60	-2	337	-287
2.642	-290	4.466	2.019	-172	37.661	469	-3	1.362	2.192
124	863	2.281	1.070	-7.350	33.051	626	27	5.188	5.502
71	195	309	337	427	682	9	4	390	358
7	23	32	33	107	158	14	7	71	65
22	60	13	16	8	8	4	2	-	-
6	1	1	1	6	6	-	-	3	2
11	23	14	15	19	21	21	13	19	19
-	1	1	2	5	8	-	-	2	3
-	-	-	1	1	-	2	-	-	-
-	-	-	-	1	2	-	-	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
31	49	58	57	47	39	59	61	54	35
148	352	428	462	621	924	109	87	540	482
-44	-65	-57	-59	-27	-2	-79	-76	-23	-10
104	287	371	403	594	922	30	11	517	472
20	576	1.910	667	-7.944	32.129	596	16	4.671	5.030
-174	-402	-	-	-	-	-	-	-2.944	-
-154	174	1.910	667	-7.944	32.129	596	16	1.727	5.030
-17	-230	-85	-81	-108	-168	-12	-4	-	-20
\$ -171	\$ -56	\$ 1.825	\$ 586	€ -8.052	€ 31.961	\$ 584	\$ 12	€ 1.727	€ 5.010

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Franklin Responsible Income 2029 Fund ^α		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
(in Tsd.)				
ANLAGEERTRÄGE:				
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	€ 1.269	€ –	\$ 546.569	\$ 645.956
Zinsen (Erläuterung 2)	2	–	174	369
Ausgleich (Erläuterung 2)	-34	–	-843	-2.057
Sonstige Erträge	–	–	163	284
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):				
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	158	–	403.503	-659.861
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	916	–	269.727	1.894.830
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	2.311	–	1.219.293	1.879.521
AUFWENDUNGEN:				
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	140	–	99.756	112.861
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	31	–	11.662	12.488
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	11.414	12.174
Rechtskosten	1	–	543	572
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	18	–	1.175	1.404
Druckkosten	1	–	488	430
Zinsaufwendungen	–	–	171	147
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	170	198
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	162	284
Sonstige Aufwendungen	21	–	4.976	4.207
Aufwendungen gesamt	212	–	130.517	144.765
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-22	–	-1.736	-1.154
Gesamtnettoaufwendungen	190	–	128.781	143.611
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	2.121	–	1.090.512	1.735.910
FINANZIERUNGSKOSTEN:				
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-153.422	-158.128
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	2.121	–	937.090	1.577.782
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-10	–	-25.852	-32.704
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 2.111	€ –	\$ 911.238	\$ 1.545.078

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 ¥/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 ¥/1.000 £.

Gewinne und Verluste haben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäftsbetrieb ergeben, außer beim TGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^α, FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^α, FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^α, FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^α und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^α, die den Geschäftsbetrieb eingestellt haben. 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^α, 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, Franklin Responsible Income 2028 Fund^α und Franklin Responsible Income 2029 Fund^α wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das am 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr zum durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,9315 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,9232).

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 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr zum durchschnittlichen USD/GBP-Kurs von 0,7851 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,7988).

^α Mit Wirkung vom 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund^α den Handel auf.

^β Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

^γ Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^α den Handel ein.

^δ Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^α den Handel ein.

^λ Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^α den Handel ein.

^δ Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^α den Handel ein.

^θ Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund^α in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund^α umbenannt.

^Ω Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^α den Handel ein.

^π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 8. Mai 2025 von der Zentralbank widerrufen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer 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 ^Δ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 13.931	\$ 9.298	\$ 4.846	\$ 2.970	\$ 28.709	\$ 30.201	€ 331	€ 6.149
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	3.361.280	2.012.301	21.329	105.441	166.248	258.516	761	1.802
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	46.926	34.623	1.182	1.254	956	1.082	5	8
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-2.855.799	-1.775.419	-114.915	-56.124	-762.395	-623.244	-50.926	-90.597
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	552.407	271.505	-92.404	50.571	-595.191	-363.646	-50.160	-88.787
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	566.338	280.803	-87.558	53.541	-566.482	-333.445	-49.829	-82.638
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	1.114.418	833.615	185.460	131.919	815.255	1.148.700	49.829	132.467
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ 1.680.756	\$ 1.114.418	\$ 97.902	\$ 185.460	\$ 248.773	\$ 815.255	€ –	€ 49.829
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^Δ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.349	\$ 678	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	6.163	4.202	–	–	–	–	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	269	272	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-15.511	-14.064	–	–	–	–	–	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-9.079	-9.590	–	–	–	–	–	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-7.730	-8.912	–	–	–	–	–	–
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	48.519	57.431	–	–	–	–	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ 40.789	\$ 48.519	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund ^{Δδ}		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund ^Δ		FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^Δ		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^Δ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -4.384	\$ 99.461	\$ 22.416	\$ 31.079	\$ 52.650	\$ 31.897	\$ 78.106	\$ 27.273
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	64.975	367.209	65.037	104.145	2.574	4.387	–	2.928
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	436	752	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-1.265.996	-1.394.954	-53.111	-37.555	-66.178	-69.676	-7.427	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-1.200.585	-1.026.993	11.926	66.590	-63.604	-65.289	-7.427	2.928
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-1.204.969	-927.532	34.342	97.669	-10.954	-33.392	70.679	30.201
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	1.204.969	2.132.501	372.681	275.012	526.156	559.548	1.149.708	1.119.507
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ –	\$ 1.204.969	\$ 407.023	\$ 372.681	\$ 515.202	\$ 526.156	\$ 1.220.387	\$ 1.149.708

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 ^{^z}				
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		
\$	–	\$	–	\$	2.774	\$	8.470	\$	4.804	\$	4.261	\$	–	\$	–	
	–		–	112.853	35.895	30.551	14.197		–		–		–		–	
	–		–	467	542	2.110	2.702		–		–		–		–	
	–		–	-115.711	-31.322	-47.390	-49.522		–		–		–		–	
	–		–	-2.391	5.115	-14.729	-32.623		–		–		–		–	
	–		–	383	13.585	-9.925	-28.362		–		–		–		–	
	–		–	240.940	227.355	96.878	125.240		–		–		–		–	
	–		–	–	–	–	–		–		–		–		–	
\$	–	\$	–	\$	241.323	\$	240.940	\$	86.953	\$	96.878	\$	–	\$	–	
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 EUR High Yield Fund ^{^z}				
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		
\$	2.121	\$	2.503	\$	11.907	\$	28.835	\$	-932	\$	7.568	\$	1.906	\$	1.513	
														€	–	
	34.096		61.423	70.014	270.177	1.102	39.375		794		562		–		–	
	106		115	34	43	–	–		–		–		–		–	
	-93.992		-251.120	-381.830	-344.487	-32.259	-64.226		-6.571		-17.128		–		–	
	-59.790		-189.582	-311.782	-74.267	-31.157	-24.851		-5.777		-16.566		–		–	
	-57.669		-187.079	-299.875	-45.432	-32.089	-17.283		-3.871		-15.053		–		–	
	250.628		437.707	478.538	523.970	129.420	146.703		30.997		46.050		–		–	
	–		–	–	–	–	–		–		–		–		–	
\$	192.959	\$	250.628	\$	178.663	\$	478.538	\$	97.331	\$	129.420	\$	27.126	\$	30.997	
													€	–	€	
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]				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				
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		
£	–	£	-1.727	\$	–	\$	-2.203	\$	–285	\$	-370	\$	–	\$	376	
														\$	-736	
	–		–	–	41	210	183		–		–		74.656		21.189	
	–		–	–	–	7	685		–		–		520		617	
	–		-44.185	–	-92.613	-11	-543		–		-9.371		-158.371		-40.065	
	–		-44.185	–	-92.572	206	325		–		-9.371		-83.195		-18.259	
	–		-45.912	–	-94.775	-79	-45		–		-8.995		-83.931		-16.924	
	–		45.912	–	94.775	18.396	18.441		–		8.995		145.085		162.009	
	–		–	–	–	–	–		–		–		–		–	
£	–	£	–	\$	–	\$	–	\$	18.317	\$	18.396	\$	–	\$	–	
													\$	61.154	\$	145.085

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund ^{^,c}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 3.865	\$ 10.679	\$ 435	\$ 3.201	\$ -5.054	\$ 5.293	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	517	50.459	19.636	24.952	10.610	39.013	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	7	9	18	3	22	16	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-16.626	-454.149	-8.166	-7.386	-33.449	-42.092	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-16.102	-403.681	11.488	17.569	-22.817	-3.063	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-12.237	-393.002	11.923	20.770	-27.871	2.230	-	-
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	146.269	539.271	31.164	10.394	207.376	205.146	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 134.032	\$ 146.269	\$ 43.087	\$ 31.164	\$ 179.505	\$ 207.376	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^{^,Ω}		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Value Fund [§]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 428	\$ 1.016	\$ 1.818	\$ 1.802	\$ -	\$ -168	\$ 178.842	\$ 136.192
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	5	3.300	32.000	-	-	967.907	472.996
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	4	-	-	-	-	1	1
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-16.257	-	-	-2.103	-	-2.366	-1.089.007	-381.289
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-16.257	9	3.300	29.897	-	-2.366	-121.099	91.708
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-15.829	1.025	5.118	31.699	-	-2.534	57.743	227.900
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	15.829	14.804	31.699	-	-	2.534	1.157.626	929.726
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ 15.829	\$ 36.817	\$ 31.699	\$ -	\$ -	\$ 1.215.369	\$ 1.157.626

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund [§]		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^{^,c}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 100.193	\$ 218.484	\$ 3.671	\$ 3.527	€ 103.756	€ 21.349	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	479.862	524.057	12.093	1.002	274.946	391.958	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	24	25	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-1.024.209	-1.017.010	-5.153	-990	-467.478	-653.242	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-544.347	-492.953	6.940	12	-192.508	-261.259	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-444.154	-274.469	10.611	3.539	-88.752	-239.910	-	-
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	1.365.510	1.639.979	16.718	13.179	822.923	1.062.833	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 921.356	\$ 1.365.510	\$ 27.329	\$ 16.718	€ 734.171	€ 822.923	\$ -	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] _γ	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ -1.764	\$ 40.391	\$ 1.160	\$ -148	\$ –	\$ -497	\$ –	\$ –	\$ 667	\$ 1.627
226.141	265.947	2.148	3.404	–	–	–	–	–	–
574	500	–	–	–	–	–	–	–	–
-461.247	-365.763	-8.814	-33.609	–	-7.892	–	–	-71.704	–
-234.532	-99.316	-6.666	-30.205	–	-7.892	–	–	-71.704	–
-236.296	-58.925	-5.506	-30.353	–	-8.389	–	–	-71.037	1.627
1.151.380	1.210.305	16.403	46.756	–	8.389	–	–	71.037	69.410
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 915.084	\$ 1.151.380	\$ 10.897	\$ 16.403	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 71.037
Legg Mason ClearBridge Growth 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	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ –	\$ –	\$ 27.095	\$ 51.292	\$ 229.727	\$ 611.575	\$ 15.378	\$ 44.881	\$ 5.467	\$ 5.114
–	–	14.272	31.681	605.213	682.765	11.463	14.386	3.831	945
–	–	2	3	2	–	–	–	8	7
–	–	-71.065	-61.130	-707.561	-647.475	-57.502	-76.670	-4.806	-8.658
–	–	-56.791	-29.446	-102.346	35.290	-46.039	-62.284	-967	-7.706
–	–	-29.696	21.846	127.381	646.865	-30.661	-17.403	4.500	-2.592
–	–	211.456	189.610	1.872.600	1.225.735	207.390	224.793	35.936	38.528
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ –	\$ –	\$ 181.760	\$ 211.456	\$ 1.999.981	\$ 1.872.600	\$ 176.729	\$ 207.390	\$ 40.436	\$ 35.936
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 [^]	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
\$ 16.339	\$ -17.550	\$ 1.058	\$ 641	\$ 8.105	\$ 40.989	\$ -2.468	\$ 8.385	\$ -60	\$ 140
94.130	64.682	–	5.000	765.250	276.127	18.608	30.088	7	11
1.898	2.357	–	–	–	–	–	–	–	–
-157.027	-123.728	–	–	-483.911	-363.755	-29.222	-20.636	-11	-19
-60.999	-56.689	–	5.000	281.339	-87.628	-10.614	9.452	-4	-8
-44.660	-74.239	1.058	5.641	289.444	-46.639	-13.082	17.837	-64	132
331.809	406.048	5.641	–	694.890	741.529	95.935	78.098	4.386	4.254
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$ 287.149	\$ 331.809	\$ 6.699	\$ 5.641	\$ 984.334	\$ 694.890	\$ 82.853	\$ 95.935	\$ 4.322	\$ 4.386

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

(in Tsd.)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex							
	Legg Mason US Equity Fund^		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^		Japan Equity Growth and Income Fund^		Legg Mason Battery March International Large Cap Fund^	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ 812	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	-	53	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	98	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	-	-22.053	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-21.902	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-	-	-21.090	-	-
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	-	-	-	21.090	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	€	€	\$	\$	\$	\$	\$	\$
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -2.326	\$ 24.013
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	-	-	11.144	23.348
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	-	-	-111.343	-64.389
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-100.199	-41.041
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-	-	-	-102.525	-17.028
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	-	-	-	-	124.021	141.049
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 21.496	\$ 124.021

(in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2029 Fund^α		Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
	€	€	\$	\$
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 2.111	€ -	\$ 911.238	\$ 1.545.078
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN				
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	73.659	-	7.671.093	6.373.287
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	55.576	45.932
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-36.624	-	-11.090.240	-9.527.821
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	37.035	-	-3.363.571	-3.108.602
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	39.146	-	-2.452.333	-1.563.524
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN				
Zu Jahresbeginn	-	-	15.900.307	17.428.030
Währungsumrechnung	-	-	-42.225	35.801
Zum Jahresende	€ 39.146	€ -	\$ 13.405.749	\$ 15.900.307

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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 [^]			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	
\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	¥	-	¥	-	\$	-	\$	127	\$	-	\$	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	12	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-3.680	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-3.665	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-3.538	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3.538	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	¥	-	¥	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund ^{^δ}				FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]				FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]				FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]				Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024	
\$	-171	\$	-56	\$	1.825	\$	586	€	-8.052	€	31.961	\$	584	\$	12	€	1.727	€	5.010
19	81	5.418	3.711	15.381	12.962	15.876	6.174	-	-	-	71.613	-	-	-	-	-	-	-	-
-	208	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-20.992	-4.210	-6.937	-7.352	-113.190	-45.142	-7.110	-	-6.480	-25.742	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-20.973	-3.921	-1.519	-3.641	-97.809	-32.180	8.766	6.174	-6.480	45.871	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-21.144	-3.977	306	-3.055	-105.861	-219	9.350	6.186	-4.753	50.881	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
21.144	25.121	31.647	34.702	188.878	189.097	6.186	-	87.704	36.823	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$	-	\$	21.144	\$	31.953	\$	31.647	€	83.017	€	188.878	\$	15.536	\$	6.186	€	82.951	€	87.704

Als „-“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 ¥/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 ¥/1.000 £.

Alle Euro-Beträge, außer des Anfang des Berichtsjahres 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[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das Berichtsjahr zum 28. Februar 2025 zum durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,9315 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,9232).

Das den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtsjahres 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[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags zum 29. Februar 2024 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9252 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,9454).

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 28. Februar 2025 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,7851 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,7988).

Das den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtsjahres für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurde zur Berechnung der Gesamtbeträge zum 29. Februar 2024 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7922 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2023: 0,8314).

α Mit Wirkung vom 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] den Handel auf.

β Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

γ Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] den Handel ein.

λ Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^] den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] den Handel ein.

θ Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^] in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^] umbenannt.

Ω Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel ein.

π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 8. Mai 2025 von der Zentralbank widerrufen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	5.955	3.012
Zurückgenommen	-4.764	-2.409
Nettozunahme	1.191	603
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1.739.070	1.210.701
Zurückgenommen	-1.386.634	-999.630
Nettozunahme	352.436	211.071
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-174	-44
Nettoabnahme	-174	-44
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-134
Nettoabnahme	–	-134
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1.005.311	500.516
Zurückgenommen	-947.677	-508.670
Nettozunahme/-abnahme	57.634	-8.154
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	7	8
Zurückgenommen	-27	-38
Nettoabnahme	-20	-30
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	41	89
Zurückgenommen	-68	-95
Nettoabnahme	-27	-6
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	260	85
Zurückgenommen	-361	-62
Nettozunahme/-abnahme	-101	23
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	4	7
Zurückgenommen	-11	-22
Nettoabnahme	-7	-15
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	6
Zurückgenommen	-3	-6
Nettoabnahme	-2	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	2	4
Zurückgenommen	-2	-2
Nettozunahme	–	2
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	33	889
Zurückgenommen	-588	-406
Nettozunahme/-abnahme	-555	483
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	32	85
Zurückgenommen	-107	-37
Nettozunahme/-abnahme	-75	48
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	15	24
Zurückgenommen	-26	-31
Nettoabnahme	-11	-7
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	145	–
Zurückgenommen	-145	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-85
Nettoabnahme	–	-85
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-37	-9
Nettoabnahme	-36	-6

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse GA USD Thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-2
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	57	167
Zurückgenommen	-331	-255
Nettoabnahme	-274	-88
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	63	98
Zurückgenommen	-100	-84
Nettozunahme/-abnahme	-37	14
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	3	3
Zurückgenommen	-12	-9
Nettoabnahme	-9	-6
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1	17
Zurückgenommen	-10	-117
Nettoabnahme	-9	-100
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-2	-3
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	11	29
Zurückgenommen	-62	-28
Nettozunahme/-abnahme	-51	1
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	2	11
Zurückgenommen	-18	-8
Nettozunahme/-abnahme	-16	3
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	5	15
Zurückgenommen	-53	-36
Nettoabnahme	-48	-21
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	532	1.383
Zurückgenommen	-3.543	-2.478
Nettoabnahme	-3.011	-1.095
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	32	79
Zurückgenommen	-50	-78
Nettozunahme/-abnahme	-18	1
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	3	13
Zurückgenommen	-11	-14
Nettoabnahme	-8	-1
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-14	-3
Nettoabnahme	-14	-2
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	655	602
Zurückgenommen	-1.676	-1.927
Nettoabnahme	-1.021	-1.325
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	94	22
Zurückgenommen	-139	-4
Nettozunahme/-abnahme	-45	18
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	61
Zurückgenommen	–	-377
Nettoabnahme	–	-316
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	748	–
Zurückgenommen	-748	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	28	20
Zurückgenommen	-163	-91
Nettoabnahme	-135	-71
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-3	-8
Nettoabnahme	-3	-8
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-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
Zurückgenommen	-13	–
Nettozunahme/-abnahme	-13	13
Klasse A EUR Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-9	–
Nettoabnahme	-9	–
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	8	7
Zurückgenommen	-62	-34
Nettoabnahme	-54	-27
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-419	-895
Nettoabnahme	-419	-895
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-5	-2
Nettoabnahme	-4	-2
Klasse GA USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-3	–
Klasse GE EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	15	28
Zurückgenommen	-17	-21
Nettozunahme/-abnahme	-2	7
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	9	10
Zurückgenommen	-14	-33
Nettoabnahme	-5	-23
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	33	23
Zurückgenommen	-17	-14
Nettozunahme	16	9
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	3	10
Zurückgenommen	-5	-12
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	9	2
Zurückgenommen	-7	-2
Nettozunahme	2	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-5	-14
Nettoabnahme	-5	-11
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme/-abnahme	-1	1

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	3	5
Zurückgenommen	-6	-21
Nettoabnahme	-3	-16
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	352	129
Zurückgenommen	-671	-157
Nettoabnahme	-319	-28
Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	2.441	320
Zurückgenommen	-1.911	-100
Nettozunahme	530	220
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	3	3
Zurückgenommen	-10	-10
Nettoabnahme	-7	-7
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	10
Zurückgenommen	-15	-17
Nettoabnahme	-11	-7
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	1
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	31	25
Zurückgenommen	-24	-19
Nettozunahme	7	6
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-8
Nettoabnahme	-1	-8
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-5	-1
Nettoabnahme	-4	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	2
Nettozunahme	4	2
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	15	52
Zurückgenommen	-18	-57
Nettoabnahme	-3	-5
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	522	–
Zurückgenommen	-522	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-2
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-7
Nettoabnahme	-1	-6
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	158	11
Zurückgenommen	-167	-26
Nettoabnahme	-9	-15
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	102	–
Zurückgenommen	-100	–
Nettozunahme	2	–
Klasse LM AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	50	81
Zurückgenommen	-336	–
Nettozunahme/-abnahme	-286	81
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	61	16
Zurückgenommen	-65	-39
Nettoabnahme	-4	-23
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	60	77
Zurückgenommen	-86	-127
Nettoabnahme	-26	-50
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	49	17
Zurückgenommen	-40	-11
Nettozunahme	9	6
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	7	2
Zurückgenommen	-5	-4
Nettozunahme/-abnahme	2	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	16	3
Zurückgenommen	-4	-3
Nettozunahme	12	–
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	9.956	1.044
Zurückgenommen	-4.883	-604
Nettozunahme	5.073	440
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-5	-2
Nettoabnahme	-4	–
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	12	3
Zurückgenommen	-3	-8
Nettozunahme/-abnahme	9	-5
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	6	3
Zurückgenommen	-9	-9
Nettoabnahme	-3	-6

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-10
Nettoabnahme	-1	-9
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	49	54
Zurückgenommen	-78	-149
Nettoabnahme	-29	-95
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	–	-5
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	16	23
Zurückgenommen	-127	-101
Nettoabnahme	-111	-78
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-3	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse GF USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	11	5
Zurückgenommen	-8	-9
Nettozunahme/-abnahme	3	-4
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	4
Zurückgenommen	-10	-6
Nettoabnahme	-6	-2
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	10	7
Zurückgenommen	-18	-18
Nettoabnahme	-8	-11
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	27	5
Zurückgenommen	-41	-24
Nettoabnahme	-14	-19
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	43	13
Zurückgenommen	-54	-29
Nettoabnahme	-11	-16
Klasse A EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-4
Nettoabnahme	-2	-4
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	3.107	2.541
Zurückgenommen	-3.851	-2.385
Nettozunahme/-abnahme	-744	156

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-2	-12
Nettoabnahme	-1	-10
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-3
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	3	8
Zurückgenommen	-2	-17
Nettozunahme/-abnahme	1	-9
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	11	52
Zurückgenommen	-40	-62
Nettoabnahme	-29	-10
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Verkauft	3	46
Zurückgenommen	-39	-49
Nettoabnahme	-36	-3
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	8
Zurückgenommen	-7	-16
Nettoabnahme	-5	-8
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-6
Nettoabnahme	–	-6
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-2	-5
Nettoabnahme	-2	–
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	27	40
Zurückgenommen	-67	-69
Nettoabnahme	-40	-29
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-7	-8
Nettoabnahme	-3	-7
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	57	92
Zurückgenommen	-106	-149
Nettoabnahme	-49	-57
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	6	8
Zurückgenommen	-19	-63
Nettoabnahme	-13	-55
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	108	31
Zurückgenommen	-157	-71
Nettoabnahme	-49	-40
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	2.151	2.257
Zurückgenommen	-1.401	-162
Nettozunahme	750	2.095
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-6	-1
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-3	-3
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	53	6
Zurückgenommen	-102	-117
Nettoabnahme	-49	-111
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	56	468
Zurückgenommen	-46	-556
Nettozunahme/-abnahme	10	-88
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	352	9.697
Zurückgenommen	-919	-9.490
Nettozunahme/-abnahme	-567	207
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	14	49
Zurückgenommen	-441	-421
Nettoabnahme	-427	-372
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-2	-4
Nettoabnahme	-2	-4
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-9
Nettoabnahme	-2	-9
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse X USD Ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	19	85
Zurückgenommen	-75	-267
Nettoabnahme	-56	-182
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	36
Zurückgenommen	–	-49
Nettoabnahme	–	-13
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	12	53
Zurückgenommen	-18	-93
Nettoabnahme	-6	-40
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	13	–
Zurückgenommen	-175	-557
Nettoabnahme	-162	-557
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	21	–
Zurückgenommen	-73	-470
Nettoabnahme	-52	-470

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-17	-63
Nettoabnahme	-17	-63
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-20	-32
Nettoabnahme	-20	-29
Klasse LM EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	8	19
Zurückgenommen	-23	-19
Nettoabnahme	-15	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	84	133
Zurückgenommen	-114	-134
Nettoabnahme	-30	-1
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	5	61
Zurückgenommen	-10	-34
Nettozunahme/-abnahme	-5	27
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	26	100
Zurückgenommen	-122	-170
Nettoabnahme	-96	-70
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	151	857
Zurückgenommen	-710	-1.106
Nettoabnahme	-559	-249
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	4	17
Zurückgenommen	-11	-20
Nettoabnahme	-7	-3
Klasse C USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	-36	-8
Nettoabnahme	-36	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	6	8
Zurückgenommen	-16	-7
Nettozunahme/-abnahme	-10	1
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	-1	-38
Nettoabnahme	-1	-38
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-17	-5
Nettoabnahme	-15	-4
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-3	-12
Nettoabnahme	-2	-11
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	21	255
Zurückgenommen	-215	-145
Nettozunahme/-abnahme	-194	110
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	78	72
Zurückgenommen	-100	-170
Nettoabnahme	-22	-98
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	40	42
Zurückgenommen	-42	–
Nettozunahme/-abnahme	-2	42

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	51	353
Zurückgenommen	-166	-891
Nettoabnahme	-115	-538
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-4	–
Nettozunahme/-abnahme	-2	2
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-4
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	92	335
Zurückgenommen	-394	-67
Nettozunahme/-abnahme	-302	268
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	31	108
Zurückgenommen	-113	-45
Nettozunahme/-abnahme	-82	63
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1.291	1325
Zurückgenommen	-3.038	-1.593
Nettoabnahme	-1.747	-268
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-155
Nettoabnahme	–	-155
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-3	-5
Nettoabnahme	-1	-5
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	11	137
Zurückgenommen	-25	-125
Nettozunahme/-abnahme	-14	12
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	160
Zurückgenommen	-205	-154
Nettozunahme/-abnahme	-205	6
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	66
Zurückgenommen	-40	-110
Nettoabnahme	-40	-44
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-38	-8
Nettoabnahme	-36	-5
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-250
Nettoabnahme	–	-250
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-21
Nettoabnahme	–	-21
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-8	-12
Nettoabnahme	-4	-11
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	1	7
Zurückgenommen	-33	-107
Nettoabnahme	-32	-100

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Credit Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	6	54
Zurückgenommen	-1	-53
Nettozunahme	5	1
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^§		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	152	313
Zurückgenommen	-2.144	-1.562
Nettoabnahme	-1.992	-1.249
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	93	173
Zurückgenommen	-1.421	-472
Nettoabnahme	-1.328	-299
Klasse A USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	19	67
Zurückgenommen	-272	-125
Nettoabnahme	-253	-58
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	9
Zurückgenommen	-25	-2
Nettozunahme/-abnahme	-25	7
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	20	43
Zurückgenommen	-279	-94
Nettoabnahme	-259	-51
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-36	-22
Nettoabnahme	-35	-18
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	7	–
Zurückgenommen	-58	-4
Nettoabnahme	-51	-4
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	-134	-86
Nettoabnahme	-134	-86
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	64	1410
Zurückgenommen	-1.693	-1.260
Nettozunahme/-abnahme	-1.629	150
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	8
Zurückgenommen	-44	-22
Nettoabnahme	-41	-14
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-56	-22
Nettoabnahme	-56	-21
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	54	8
Zurückgenommen	-122	-11
Nettoabnahme	-68	-3
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	-26	-26
Nettoabnahme	-26	-19
Klasse A GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	35
Zurückgenommen	-83	-73
Nettoabnahme	-82	-38
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-7
Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme/-abnahme	-4	2

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse A NOK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	860	346
Zurückgenommen	-1.392	-554
Nettoabnahme	-532	-208
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5	14
Zurückgenommen	-110	-67
Nettoabnahme	-105	-53
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	611	6.079
Zurückgenommen	-8.416	-10.142
Nettoabnahme	-7.805	-4.063
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	864	1.611
Zurückgenommen	-34.102	-13.899
Nettoabnahme	-33.238	-12.288
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	-50	–
Nettoabnahme	-50	–
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	5	16
Zurückgenommen	-276	-70
Nettoabnahme	-271	-54
Klasse C USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	3	4
Zurückgenommen	-46	-8
Nettoabnahme	-43	-4
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	1	11
Zurückgenommen	-95	-59
Nettoabnahme	-94	-48
Klasse E USD Ausschüttend (S)		
Zurückgenommen	-11	-5
Nettoabnahme	-11	-5
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-27	-6
Nettoabnahme	-25	-4
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	6	34
Zurückgenommen	-289	-200
Nettoabnahme	-283	-166
Klasse F USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	7	13
Zurückgenommen	-40	-53
Nettoabnahme	-33	-40
Klasse R EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	140	–
Zurückgenommen	-140	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	43	91
Zurückgenommen	-479	-374
Nettoabnahme	-436	-283
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	57
Zurückgenommen	-37	-218
Nettoabnahme	-37	-161
Klasse X USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	10	4
Zurückgenommen	-97	-44
Nettoabnahme	-87	-40
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-73	-24
Nettoabnahme	-72	-22
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	165	569
Zurückgenommen	-591	-577
Nettoabnahme	-426	-8

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]§ – (Fortsetzung)		
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-12	-3
Nettoabnahme	-11	-2
Klasse X EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-38	-81
Nettoabnahme	-38	-79
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-6	-24
Nettoabnahme	-6	-24
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	6	19
Zurückgenommen	-161	-150
Nettoabnahme	-155	-131
Klasse X GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	-5	–
Nettoabnahme	-5	–
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	5	5
Zurückgenommen	-19	-12
Nettoabnahme	-14	-7
Klasse X SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	676
Zurückgenommen	-2.410	-3.224
Nettoabnahme	-2.410	-2.548
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	13	107
Zurückgenommen	-355	-1.673
Nettoabnahme	-342	-1.566
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	50	9
Zurückgenommen	-207	-110
Nettoabnahme	-157	-101
Klasse Premier AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-13	-1
Nettoabnahme	-13	-1
Klasse Premier AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	4	7
Zurückgenommen	-21	-37
Nettoabnahme	-17	-30
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	15	19
Zurückgenommen	-809	-513
Nettoabnahme	-794	-494
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	7	1
Zurückgenommen	-38	-13
Nettoabnahme	-31	-12
Klasse Premier CHF Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	90	–
Zurückgenommen	-103	-1
Nettoabnahme	-13	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	12	483
Zurückgenommen	-806	-2.982
Nettoabnahme	-794	-2.499
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	217
Zurückgenommen	-87	-268
Nettoabnahme	-86	-51
Klasse Premier EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	94	223
Zurückgenommen	-416	-356
Nettoabnahme	-322	-133
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	11
Zurückgenommen	-30	-33
Nettoabnahme	-29	-22
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	10	131
Zurückgenommen	-197	-162
Nettoabnahme	-187	-31

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-712	-24
Nettoabnahme	-712	-21
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	106	37
Zurückgenommen	-180	-15
Nettozunahme/-abnahme	-74	22
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-3	–
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	9
Zurückgenommen	–	-9
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-20	-1.212
Nettoabnahme	-20	-1.209
Klasse LM AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	15	68
Zurückgenommen	-191	-234
Nettoabnahme	-176	-166
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-4	-5
Nettoabnahme	-4	-4
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	372	–
Nettozunahme	372	–
Klasse X CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	3	16
Zurückgenommen	-5	-18
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	14	80
Zurückgenommen	-4	-108
Nettozunahme/-abnahme	10	-28
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	85	59
Zurückgenommen	-31	-27
Nettozunahme	54	32
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	7
Zurückgenommen	-6	-36
Nettoabnahme	-2	-29
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	14	175
Zurückgenommen	-84	-85
Nettozunahme/-abnahme	-70	90
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	588	515
Zurückgenommen	-658	-128
Nettozunahme/-abnahme	-70	387
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Klasse D USD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-7	-110
Nettoabnahme	-7	-105
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-3	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse D USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	9	–
Zurückgenommen	-4	-9
Nettozunahme/-abnahme	5	-9
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	9
Zurückgenommen	-1	-9
Nettozunahme	–	–
Klasse D EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse M USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme	1	1
Klasse M EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	8	84
Zurückgenommen	-408	-167
Nettoabnahme	-400	-83
Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	11	19
Zurückgenommen	-64	-14
Nettozunahme/-abnahme	-53	5
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-32
Nettoabnahme	-3	-31
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-6
Nettoabnahme	–	-5
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-500
Nettoabnahme	–	-500
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	3.021	–
Zurückgenommen	-3.023	–
Nettoabnahme	-2	–
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	30
Zurückgenommen	-70	–
Nettozunahme/-abnahme	-70	30
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	10.625	–
Zurückgenommen	-10.625	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		
Klasse LM GBP Ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	–	-504
Nettoabnahme	–	-504
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-164
Nettoabnahme	–	-164
Klasse LM GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-704
Nettoabnahme	–	-704

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^		
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	3	12
Zurückgenommen	–	-8
Nettozunahme	3	4
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-25
Nettoabnahme	–	-25
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-140
Nettoabnahme	–	-140
Klasse S USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-48
Nettoabnahme	–	-48
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	19	19
Zurückgenommen	-34	-34
Nettoabnahme	-15	-15
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	5	13
Zurückgenommen	-5	-10
Nettozunahme	–	3
Klasse A USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	19	29
Zurückgenommen	-107	-59
Nettoabnahme	-88	-30
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	8	–
Zurückgenommen	–	-5
Nettozunahme/-abnahme	8	-5
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	3	37
Zurückgenommen	-99	-48
Nettoabnahme	-96	-11
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	166	1
Zurückgenommen	-54	-3
Nettozunahme/-abnahme	112	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	4
Zurückgenommen	-56	-10
Nettoabnahme	-54	-6
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	44	–
Zurückgenommen	-6	–
Nettozunahme	38	–
Klasse A GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-25	-7
Nettoabnahme	-23	-4
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	21	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	16	–
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	22	1858
Zurückgenommen	-100	-1.854
Nettozunahme/-abnahme	-78	4
Klasse B USD Ausschüttend (S)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Ausschüttend (S)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	-4	-4
Nettoabnahme	-4	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	-4	-1
Nettoabnahme	-4	-1
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	84	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettozunahme	81	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-26	-3
Nettoabnahme	-26	-2
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	-8	-2
Nettozunahme/-abnahme	-8	5
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme/-abnahme	2	-1
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	19
Zurückgenommen	-32	-30
Nettoabnahme	-23	-11
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	15	30
Zurückgenommen	-66	-67
Nettoabnahme	-51	-37
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	4	20
Zurückgenommen	-43	-22
Nettoabnahme	-39	-2
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	62	70
Zurückgenommen	-37	-80
Nettozunahme/-abnahme	25	-10
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	6	6
Zurückgenommen	-194	-11
Nettoabnahme	-188	-5
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	25
Zurückgenommen	-55	-7
Nettozunahme/-abnahme	-54	18
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	62	–
Zurückgenommen	-61	-8
Nettozunahme/-abnahme	1	-8
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-8	-5
Nettoabnahme	-7	-5

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-3	-5
Nettoabnahme	-3	-3
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	1	–
Klasse LM USD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	18	22
Zurückgenommen	-308	-54
Nettoabnahme	-290	-32
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	339	2
Zurückgenommen	-327	-6
Nettozunahme/-abnahme	12	-4
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	–	3.319
Zurückgenommen	–	-3.318
Nettozunahme	–	1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	-1	3
Klasse E USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	24	305
Zurückgenommen	-54	-1.279
Nettoabnahme	-30	-974
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	26
Zurückgenommen	-5	-946
Nettoabnahme	-4	-920
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	–	11
Zurückgenommen	–	-348
Nettoabnahme	–	-337
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	2	113
Zurückgenommen	-128	-83
Nettozunahme/-abnahme	-126	30
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1.698
Nettoabnahme	–	-1.698
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	30	20
Zurückgenommen	-5	-1
Nettozunahme	25	19
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	71	22
Zurückgenommen	-5	-7
Nettozunahme	66	15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	16	1
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	15	1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	89
Zurückgenommen	-41	-48
Nettozunahme/-abnahme	-41	41
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	10	–
Nettozunahme	10	–
Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	61	–
Zurückgenommen	-6	–
Nettozunahme	55	–
Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	74
Nettozunahme	–	74
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	1	28
Zurückgenommen	-18	-32
Nettoabnahme	-17	-4
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-4	-2
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	18	6.758
Zurückgenommen	-19	-6.773
Nettoabnahme	-1	-15
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-15	-5
Nettoabnahme	-15	-5
Klasse F USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	2	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-9	-2
Nettoabnahme	-7	-2
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettozunahme/-abnahme	1	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	1087	290
Zurückgenommen	-1.233	-264
Nettozunahme/-abnahme	-146	26
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-17	-2
Nettoabnahme	-17	-1
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-14	-22
Nettoabnahme	-14	-21
Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	14	7
Zurückgenommen	-4	-30
Nettozunahme/-abnahme	10	-23

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	367	390
Zurückgenommen	-693	-454
Nettoabnahme	-326	-64
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-12	-7
Nettoabnahme	-11	-4
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	44	45
Zurückgenommen	-92	-37
Nettozunahme/-abnahme	-48	8
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	158	153
Zurückgenommen	-339	-352
Nettoabnahme	-181	-199
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	56	102
Zurückgenommen	-135	-202
Nettoabnahme	-79	-100
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-3	–
Nettozunahme/-abnahme	-3	3
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	–	28
Zurückgenommen	-11	-36
Nettoabnahme	-11	-8
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	56	58
Zurückgenommen	-7	-15
Nettozunahme	49	43
Klasse A CZK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	11	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	10	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	57	195
Zurückgenommen	-206	-102
Nettozunahme/-abnahme	-149	93
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	11	179
Zurückgenommen	-74	-192
Nettoabnahme	-63	-13
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	108	79
Zurückgenommen	-154	-109
Nettoabnahme	-46	-30
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-7	-6
Nettoabnahme	-6	-3
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	9	10
Zurückgenommen	-30	-13
Nettoabnahme	-21	-3
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	-6	-6
Nettoabnahme	-6	-2
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	13	12
Zurückgenommen	-16	-9
Nettozunahme/-abnahme	-3	3
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	118	64
Zurückgenommen	-245	-242
Nettoabnahme	-127	-178
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	12.837	9.353
Zurückgenommen	-15.440	-9.625
Nettoabnahme	-2.603	-272

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	4.938	3.406
Zurückgenommen	-19.251	-7.331
Nettoabnahme	-14.313	-3.925
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	518	132
Zurückgenommen	-2.497	-3.140
Nettoabnahme	-1.979	-3.008
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	39	69
Zurückgenommen	-128	-144
Nettoabnahme	-89	-75
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	23	31
Zurückgenommen	-29	-4
Nettozunahme/-abnahme	-6	27
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	76	178
Zurückgenommen	-235	-142
Nettozunahme/-abnahme	-159	36
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	3	5
Zurückgenommen	-3	-2
Nettozunahme	–	3
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	20
Zurückgenommen	-15	-11
Nettozunahme/-abnahme	-6	9
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	37	62
Zurückgenommen	-110	-124
Nettoabnahme	-73	-62
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	15	11
Zurückgenommen	-35	-11
Nettoabnahme	-20	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	44	19
Zurückgenommen	-33	-75
Nettozunahme/-abnahme	11	-56
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	12	4
Zurückgenommen	-22	-36
Nettoabnahme	-10	-32
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	10	12
Zurückgenommen	-94	-93
Nettoabnahme	-84	-81
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	4	2
Zurückgenommen	-3	-2
Nettozunahme	1	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	7	16
Zurückgenommen	-138	-64
Nettoabnahme	-131	-48
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-17	-25
Nettoabnahme	-13	-24
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	157	654
Zurückgenommen	-190	-332
Nettozunahme/-abnahme	-33	322

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	50	7
Zurückgenommen	-135	-46
Nettoabnahme	-85	-39
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-7	-115
Nettoabnahme	-7	-114
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	104	172
Zurückgenommen	-322	-399
Nettoabnahme	-218	-227
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	73	308
Zurückgenommen	-350	-307
Nettozunahme/-abnahme	-277	1
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-3	-72
Nettoabnahme	-3	-67
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	53
Zurückgenommen	-8	-22
Nettozunahme/-abnahme	-8	31
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	126	213
Zurückgenommen	-166	-297
Nettoabnahme	-40	-84
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	26	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	25	-2
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	39	67
Zurückgenommen	-304	-192
Nettoabnahme	-265	-125
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	3	2
Zurückgenommen	-11	-9
Nettoabnahme	-8	-7
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-2
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	–	84
Zurückgenommen	–	-50
Nettozunahme	–	34
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	83	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	82	–
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	45	8
Zurückgenommen	-22	-34
Nettozunahme/-abnahme	23	-26
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	795	269
Zurückgenommen	-462	-304
Nettozunahme/-abnahme	333	-35
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	449	12
Zurückgenommen	-552	-63
Nettoabnahme	-103	-51
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^A		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	16	–
Zurückgenommen	-2	-106
Nettozunahme/-abnahme	14	-106
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	20	34
Zurückgenommen	-53	-193
Nettoabnahme	-33	-159

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-30	–
Nettoabnahme	-30	–
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
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[^]γ		
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-120	–
Nettoabnahme	-120	–
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1.223	–
Nettoabnahme	-1.223	–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]Ω		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-148	–
Nettoabnahme	-148	–
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	31	320
Zurückgenommen	–	-20
Nettozunahme	31	300
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
S Klasse EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-7
FTGF ClearBridge US Value Fund^β		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	198	170
Zurückgenommen	-300	-271
Nettoabnahme	-102	-101
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	18	14
Zurückgenommen	-21	-31
Nettoabnahme	-3	-17
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	10	3
Zurückgenommen	-4	-25
Nettozunahme/-abnahme	6	-22
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	94	79
Zurückgenommen	-90	-44
Nettozunahme	4	35
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	227	270
Zurückgenommen	-303	-436
Nettoabnahme	-76	-166

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	1.353	1.138
Zurückgenommen	-1.641	-691
Nettozunahme/-abnahme	-288	447
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	29	7
Zurückgenommen	-13	-28
Nettozunahme/-abnahme	16	-21
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	39	7
Zurückgenommen	-10	-21
Nettozunahme/-abnahme	29	-14
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	24	24
Zurückgenommen	-18	-27
Nettozunahme/-abnahme	6	-3
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	28	15
Zurückgenommen	-17	-1
Nettozunahme	11	14
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	37	34
Zurückgenommen	-19	-27
Nettozunahme	18	7
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	1.334	37
Zurückgenommen	-128	-31
Nettozunahme	1.206	6
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	418	305
Zurückgenommen	-1.122	-446
Nettoabnahme	-704	-141
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-2	-12
Nettozunahme/-abnahme	1	-12
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	752	1.060
Zurückgenommen	-1.230	-687
Nettozunahme/-abnahme	-478	373
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	249	376
Zurückgenommen	-250	-327
Nettozunahme/-abnahme	-1	49
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	2.753	991
Zurückgenommen	-2.632	-42
Nettozunahme	121	949
LM Klasse USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	19	9
Zurückgenommen	-26	-27
Nettoabnahme	-7	-18
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	27	26
Zurückgenommen	-36	-41
Nettoabnahme	-9	-15
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	12
Zurückgenommen	-15	-18
Nettoabnahme	-15	-6
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	-3	-2
Nettozunahme/-abnahme	-3	2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)		
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	7	2
Zurückgenommen	-8	-9
Nettoabnahme	-1	-7
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-4	-3
Nettoabnahme	-4	-3
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	5	3
Zurückgenommen	-10	-17
Nettoabnahme	-5	-14
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	5	9
Zurückgenommen	-13	-30
Nettoabnahme	-8	-21
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-5	-3
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	6	6
Zurückgenommen	-4	-15
Nettozunahme/-abnahme	2	-9
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-4	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	37
Zurückgenommen	-46	-34
Nettozunahme/-abnahme	-46	3
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	-27	-24
Nettoabnahme	-27	-17
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-4	-6
Nettoabnahme	-4	-5
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse GA USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	161	157
Zurückgenommen	219	-184
Nettoabnahme	-58	-27
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	24	25
Zurückgenommen	-30	-30
Nettoabnahme	-6	-5
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	26	54
Zurückgenommen	-29	-21
Nettozunahme/-abnahme	-3	33
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	21	23
Zurückgenommen	-26	-23
Nettoabnahme	-5	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	11	12
Zurückgenommen	-17	-22
Nettoabnahme	-6	-10
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-4	-4
Nettoabnahme	-4	-3
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	11	7
Zurückgenommen	-13	-14
Nettoabnahme	-2	-7
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	111	102
Zurückgenommen	-123	-416
Nettoabnahme	-12	-314
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	7	27
Zurückgenommen	-13	-39
Nettoabnahme	-6	-12
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	40	54
Zurückgenommen	-98	-81
Nettoabnahme	-58	-27
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	37
Zurückgenommen	-35	-9
Nettozunahme/-abnahme	-26	28
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	14	15
Zurückgenommen	-9	-3
Nettozunahme	5	12
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	20	30
Zurückgenommen	-31	-22
Nettozunahme/-abnahme	-11	8
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	417	785
Zurückgenommen	-657	-439
Nettozunahme/-abnahme	-240	346
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	11	2
Zurückgenommen	-11	-14
Nettoabnahme	–	-12
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	341	144
Zurückgenommen	-77	-272
Nettozunahme/-abnahme	264	-128
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	101	401
Zurückgenommen	-65	-295
Nettozunahme	36	106
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	113	86
Zurückgenommen	-144	-72
Nettozunahme/-abnahme	-31	14
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	5	13
Zurückgenommen	-15	-5
Nettozunahme/-abnahme	-10	8
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	40	157
Zurückgenommen	-87	-94
Nettozunahme/-abnahme	-47	63
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	276	338
Zurückgenommen	-293	-575
Nettoabnahme	-17	-237
Klasse S USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	145	83
Zurückgenommen	-19	–
Nettozunahme	126	83

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	371	564
Zurückgenommen	-137	-240
Nettozunahme	234	324
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	161	34
Zurückgenommen	-161	-211
Nettoabnahme	–	-177
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	21	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme/-abnahme	20	-1
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse GA USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	33	36
Zurückgenommen	-75	-93
Nettoabnahme	-42	-57
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	5
Zurückgenommen	-24	-19
Nettoabnahme	-21	-14
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	22	6
Zurückgenommen	-27	-21
Nettoabnahme	-5	-15
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	17	80
Zurückgenommen	-30	-94
Nettoabnahme	-13	-14
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	6	4
Zurückgenommen	-9	-5
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse A GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	5	–
Zurückgenommen	-4	-4
Nettozunahme/-abnahme	1	-4
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-1	-3
Nettozunahme	–	1
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	361	3.216
Zurückgenommen	-3.086	-840
Nettozunahme/-abnahme	-2.725	2.376
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-5	-7
Nettoabnahme	-4	-4
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-5	-8
Nettoabnahme	-4	-7

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-7	-7
Nettoabnahme	-4	-7
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-7	-11
Nettoabnahme	-5	-8
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-1	-5
Nettozunahme/-abnahme	1	-5
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-4	-6
Nettoabnahme	–	-5
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	5	13
Zurückgenommen	-11	-18
Nettoabnahme	-6	-5
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	-2	-70
Nettoabnahme	-2	-62
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	26	10
Zurückgenommen	-55	-52
Nettoabnahme	-29	-42
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-9	-8
Nettoabnahme	-8	-7
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-8	-3
Nettoabnahme	-8	-3
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	18	4
Zurückgenommen	-15	-22
Nettozunahme/-abnahme	3	-18
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	11	3
Zurückgenommen	-8	-14
Nettozunahme/-abnahme	3	-11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	10	–
Zurückgenommen	-10	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	6	1
Zurückgenommen	-7	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	9	1
Zurückgenommen	-2	-5
Nettozunahme/-abnahme	7	-4
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	232	324
Zurückgenommen	-111	-1.019
Nettozunahme/-abnahme	121	-695
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	9	16
Zurückgenommen	-19	-37
Nettoabnahme	-10	-21
Klasse F EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	271	135
Zurückgenommen	-392	-166
Nettoabnahme	-121	-31
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	33	17
Zurückgenommen	-53	-25
Nettoabnahme	-20	-8
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	24	39
Zurückgenommen	-56	-65
Nettoabnahme	-32	-26
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	7	12
Zurückgenommen	-51	-14
Nettoabnahme	-44	-2
Klasse A SEK Thesaurierend		
Verkauft	40	88
Zurückgenommen	-420	-450
Nettoabnahme	-380	-362
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-16	-20
Nettoabnahme	-14	-20
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	3	25
Zurückgenommen	-29	-97
Nettoabnahme	-26	-72
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-3
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	8	38
Zurückgenommen	-17	-23
Nettozunahme/-abnahme	-9	15

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	2	53
Zurückgenommen	-46	-8
Nettozunahme/-abnahme	-44	45
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	4
Zurückgenommen	-4	-14
Nettoabnahme	–	-10
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	159	536
Zurückgenommen	-609	-1.245
Nettoabnahme	-450	-709
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	101	224
Zurückgenommen	-602	-311
Nettoabnahme	-501	-87
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-1	-117
Nettoabnahme	-1	-117
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-4	-16
Nettoabnahme	-3	-14
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	104	64
Zurückgenommen	-77	-42
Nettozunahme	27	22
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	964	1.582
Zurückgenommen	-2.077	-2.199
Nettoabnahme	-1.113	-617
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	386	4
Zurückgenommen	-369	-5
Nettozunahme/-abnahme	17	-1
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	422	187
Zurückgenommen	-380	-75
Nettozunahme	42	112
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	246	40
Zurückgenommen	-326	-186
Nettoabnahme	-80	-146
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	224	144
Zurückgenommen	-212	-516
Nettozunahme/-abnahme	12	-372
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	76	49
Zurückgenommen	-32	-27
Nettozunahme	44	22
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	134	37
Zurückgenommen	-41	-61
Nettozunahme/-abnahme	93	-24
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[®]		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	63	14
Zurückgenommen	-25	-14
Nettozunahme	38	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1.987	1.469
Zurückgenommen	-1.717	-3.033
Nettozunahme/-abnahme	270	-1.564
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	646	206
Zurückgenommen	-638	-1.432
Nettozunahme/-abnahme	8	-1.226
Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1.942	1.143
Zurückgenommen	-2.128	-1.908
Nettoabnahme	-186	-765

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	21	42
Zurückgenommen	-66	-89
Nettoabnahme	-45	-47
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	86	128
Zurückgenommen	-189	-111
Nettozunahme/-abnahme	-103	17
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1327	10.144
Zurückgenommen	-13.588	-6.620
Nettozunahme/-abnahme	-12.261	3.524
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	122	71
Zurückgenommen	-113	-360
Nettozunahme/-abnahme	9	-289
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	3.448	4.494
Zurückgenommen	-3.323	-6.167
Nettozunahme/-abnahme	125	-1.673
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	76	17
Zurückgenommen	-13	-17
Nettozunahme	63	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	73	150
Zurückgenommen	-154	-168
Nettoabnahme	-81	-18
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	2.831	2945
Zurückgenommen	-3.677	-2.177
Nettozunahme/-abnahme	-846	768
Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	24	36
Zurückgenommen	-25	-68
Nettoabnahme	-1	-32
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	12	140
Zurückgenommen	-68	-327
Nettoabnahme	-56	-187
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	48	14
Zurückgenommen	-57	-124
Nettoabnahme	-9	-110
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	14	53
Zurückgenommen	-83	-222
Nettoabnahme	-69	-169
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	79	12
Zurückgenommen	-3	-3
Nettozunahme	76	9
Klasse E EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	22	–
Zurückgenommen	-7	–
Nettozunahme	15	–
Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	198	50
Zurückgenommen	-58	-371
Nettozunahme/-abnahme	140	-321
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	26	182
Zurückgenommen	-147	-194
Nettoabnahme	-121	-12
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	23	28
Zurückgenommen	-10	-137
Nettozunahme/-abnahme	13	-109

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	42
Zurückgenommen	-18	-54
Nettoabnahme	-18	-12
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	61	641
Zurückgenommen	-96	-1.363
Nettoabnahme	-35	-722
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	725	1200
Zurückgenommen	-738	-3.580
Nettoabnahme	-13	-2.380
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (Abgesichert)		
Verkauft	7	–
Zurückgenommen	–	-34
Nettozunahme/-abnahme	7	-34
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	125	69
Zurückgenommen	-83	-120
Nettozunahme/-abnahme	42	-51
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	1121	718
Zurückgenommen	-748	-3.209
Nettozunahme/-abnahme	373	-2.491
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-81	-485
Nettoabnahme	-78	-485
Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	156	169
Zurückgenommen	–	-810
Nettozunahme/-abnahme	156	-641
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	674	926
Zurückgenommen	-752	-642
Nettozunahme/-abnahme	-78	284
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	1.566	7.787
Zurückgenommen	-8.471	-12.493
Nettoabnahme	-6.905	-4.706
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	12
Zurückgenommen	-1	-27
Nettoabnahme	-1	-15
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	15	14
Zurückgenommen	-81	-458
Nettoabnahme	-66	-444
Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	515	1501
Zurückgenommen	-3.390	-2.586
Nettoabnahme	-2.875	-1.085
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	7.176	7.090
Zurückgenommen	-2.810	-2.566
Nettozunahme	4.366	4524
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	8	15
Zurückgenommen	-84	-92
Nettoabnahme	-76	-77
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	41	48
Zurückgenommen	-215	-201
Nettoabnahme	-174	-153
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	43	48
Zurückgenommen	-217	-200
Nettoabnahme	-174	-152
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	5	8
Zurückgenommen	-11	-36
Nettoabnahme	-6	-28

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	30	58
Zurückgenommen	-56	-29
Nettozunahme/-abnahme	-26	29
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	26	12
Zurückgenommen	-41	-18
Nettoabnahme	-15	-6
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-5	-6
Nettoabnahme	-4	-2
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	-17	-54
Nettoabnahme	-17	-54
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	16.541	11.949
Zurückgenommen	-31.355	-24.627
Nettoabnahme	-14.814	-12.678
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	11	65
Zurückgenommen	-12	-237
Nettoabnahme	-1	-172
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	3	7
Zurückgenommen	-5	-22
Nettoabnahme	-2	-15
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-4
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	94	5
Zurückgenommen	-3	-9
Nettozunahme/-abnahme	91	-4
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	603	216
Zurückgenommen	-363	-155
Nettozunahme	240	61
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	2	61
Zurückgenommen	-294	-106
Nettoabnahme	-292	-45
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	7	128
Zurückgenommen	-98	-68
Nettozunahme/-abnahme	-91	60
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	8	61
Zurückgenommen	-16	-13
Nettozunahme/-abnahme	-8	48
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	51	12
Zurückgenommen	-24	-67
Nettozunahme/-abnahme	27	-55
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	4	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	1	-1
Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	7	2
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	2	2

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse S GBP Thesaurierend		
Verkauft	25	10
Zurückgenommen	-29	-7
Nettozunahme/-abnahme	-4	3
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	8	4
Zurückgenommen	-2	-2
Nettozunahme	6	2
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	30	7
Zurückgenommen	-10	-1
Nettozunahme	20	6
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	52	67
Zurückgenommen	-114	-56
Nettozunahme/-abnahme	-62	11
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	3	9
Zurückgenommen	-18	-33
Nettoabnahme	-15	-24

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	–	14
Nettozunahme	–	14
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	50
Nettozunahme	–	50

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund Klasse A USD Thesaurierend

Verkauft	397	161
Zurückgenommen	-349	-176
Nettozunahme/-abnahme	48	-15

Klasse A USD Ausschüttend (A)

Verkauft	25	5
Zurückgenommen	-19	-9
Nettozunahme/-abnahme	6	-4

Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	58	24
Zurückgenommen	-61	-28
Nettoabnahme	-3	-4

Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	137	158
Zurückgenommen	-187	-129
Nettozunahme/-abnahme	-50	29

Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	89	30
Zurückgenommen	-46	-60
Nettozunahme/-abnahme	43	-30

Klasse A EUR Thesaurierend

Verkauft	188	39
Zurückgenommen	-56	-51
Nettozunahme/-abnahme	132	-12

Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)

Verkauft	3	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettozunahme	–	–

Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	–	-1

Klasse A GBP ausschüttend (A)

Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1

Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	3	2
Zurückgenommen	-1	-3
Nettozunahme/-abnahme	2	-1

Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)

Verkauft	7.743	8696
Zurückgenommen	-15.088	-4.281
Nettozunahme/-abnahme	-7.345	4.415

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	1.358	1.913
Zurückgenommen	-1.896	-4.463
Nettoabnahme	-538	-2.550
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	22	10
Zurückgenommen	-10	-17
Nettozunahme/-abnahme	12	-7
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	59	24
Zurückgenommen	-21	-23
Nettozunahme	38	1
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5	12
Zurückgenommen	-4	-3
Nettozunahme	1	9
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	15	5
Zurückgenommen	-4	-2
Nettozunahme	11	3
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	16	2
Zurückgenommen	-12	-18
Nettozunahme/-abnahme	4	-16
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse R EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	62	123
Zurückgenommen	-125	-103
Nettozunahme/-abnahme	-63	20
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	14	–
Zurückgenommen	-3	–
Nettozunahme	11	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	113	57
Zurückgenommen	-40	-52
Nettozunahme	73	5
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	204	40
Zurückgenommen	-47	-18
Nettozunahme	157	22
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	41	17
Zurückgenommen	-31	-32
Nettozunahme/-abnahme	10	-15
Klasse X GBP ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-3
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	833	244
Zurückgenommen	-508	-419
Nettozunahme/-abnahme	325	-175
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-109	-60
Nettoabnahme	-107	-60
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	142	58
Zurückgenommen	-133	-22
Nettozunahme	9	36

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	79	38
Zurückgenommen	-41	-59
Nettozunahme/-abnahme	38	-21
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	15	56
Zurückgenommen	-29	-94
Nettoabnahme	-14	-38
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	372	97
Zurückgenommen	-433	-8
Nettozunahme/-abnahme	-61	89
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	20	43
Zurückgenommen	-33	-42
Nettozunahme/-abnahme	-13	1
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	4	4
Zurückgenommen	-6	-7
Nettoabnahme	-2	-3
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	13	2
Zurückgenommen	-3	-4
Nettozunahme/-abnahme	10	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-2	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme	1	–
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	5	15
Zurückgenommen	-6	-5
Nettozunahme/-abnahme	-1	10
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse R USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	1	37
Zurückgenommen	-31	-8
Nettozunahme/-abnahme	-30	29
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	62	4
Zurückgenommen	-58	-10
Nettozunahme/-abnahme	4	-6

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme	–	1
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^Δ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-12
Nettoabnahme	–	-12
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-13
Nettoabnahme	–	-13
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-38
Nettoabnahme	–	-38
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	-45
Nettoabnahme	–	-45
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	-16
Nettoabnahme	–	-16
Klasse A EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-139
Nettoabnahme	–	-139
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	-48
Nettoabnahme	–	-48
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-6
Nettoabnahme	–	-6
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse GA USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-45
Nettoabnahme	–	-45
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse GE USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^Δ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse M GBP Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-85
Nettoabnahme	–	-85

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse M USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-26
Nettoabnahme	–	-26
Klasse M EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-15
Nettoabnahme	–	-15
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^Δ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-18	-10
Nettoabnahme	-18	-5
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-89	-1
Nettoabnahme	-89	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-12	-11
Nettoabnahme	-12	-10
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-9	-13
Nettoabnahme	-9	-8
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse X USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-6	-4
Nettozunahme/-abnahme	-6	1
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-3	-5
Nettoabnahme	-3	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	8	5
Zurückgenommen	-65	-21
Nettoabnahme	-57	-16
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-63
Nettoabnahme	–	-63
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	64	207
Zurückgenommen	-617	-523
Nettoabnahme	-553	-316
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	8	54
Zurückgenommen	-41	-67
Nettoabnahme	-33	-13
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^{Δδ}		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-54	-15
Nettoabnahme	-54	-12

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^Δ – (Fortsetzung)		
Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	-7	–
Nettoabnahme	-7	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	-5	–
Nettoabnahme	-5	–
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	26	19
Zurückgenommen	-97	-18
Nettozunahme/-abnahme	-71	1
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-10
Nettoabnahme	–	-10
Klasse D USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-36	-12
Nettoabnahme	-36	-12
Klasse D AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	-6
Nettoabnahme	–	-6
Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	-325	-89
Nettoabnahme	-325	-89
Klasse X USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-45	-1
Nettoabnahme	-45	-1
Klasse X AUD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-3	–
Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	-4	–
Nettoabnahme	-4	–
Klasse LM AUD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-47	–
Nettoabnahme	-47	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^Δ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	1	15
Zurückgenommen	-23	-20
Nettoabnahme	-22	-5
Klasse E USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	3	21
Zurückgenommen	-29	-29
Nettoabnahme	-26	-8
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	45	–
Zurückgenommen	-7	-20
Nettozunahme/-abnahme	38	-20
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-5	–
Nettoabnahme	-5	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^Δ		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	4	2
Zurückgenommen	-8	-3
Nettoabnahme	-4	-1
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-3
Nettozunahme	–	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	15
Zurückgenommen	-35	-58
Nettoabnahme	-33	-43
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	24	1
Zurückgenommen	-30	-1
Nettoabnahme	-6	–
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse P1 EUR Thesaurierend		
Verkauft	81	40
Zurückgenommen	-576	-85
Nettoabnahme	-495	-45
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Verkauft	65	76
Zurückgenommen	-314	-361
Nettoabnahme	-249	-285
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^Δ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	10
Zurückgenommen	–	-3
Nettozunahme	1	7
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	47
Nettozunahme	–	47
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	30	4
Zurückgenommen	-31	–
Nettozunahme/-abnahme	-1	4
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Verkauft	21	–
Zurückgenommen	-14	–
Nettozunahme	7	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	70	–
Zurückgenommen	-11	–
Nettozunahme	59	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^Δ		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	123
Zurückgenommen	-20	-27
Nettozunahme/-abnahme	-20	96
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	2	413
Zurückgenommen	-25	-32
Nettozunahme/-abnahme	-23	381
Klasse D EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	15
Zurückgenommen	-4	-5
Nettozunahme/-abnahme	-4	10
Klasse D EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	1
Klasse K EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse K EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)	29. Februar 2024 Anteile (in Tsd.)
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-1	-97
Nettoabnahme	-1	-92
Klasse X EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	201
Zurückgenommen	-17	-128
Nettozunahme/-abnahme	-16	73
Franklin Responsible Income 2029 Fund^{^α}		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	98	–
Zurückgenommen	-26	–
Nettozunahme	72	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	286	–
Zurückgenommen	-36	–
Nettozunahme	250	–
Klasse D EUR Thesaurierend		
Verkauft	25	–
Zurückgenommen	-25	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	25	–
Zurückgenommen	-25	–
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Thesaurierend		
Verkauft	25	–
Zurückgenommen	-25	–
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	25	–
Zurückgenommen	-25	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	25	–
Zurückgenommen	-25	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	224	–
Zurückgenommen	-175	–
Nettozunahme	49	–

– 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 27. März 2024 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] den Handel auf.

β Mit Wirkung vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

γ Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] den Handel ein.

λ Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^] den Handel ein.

δ Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] den Handel ein.

θ Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^] in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^] umbenannt.

Ω Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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 Umbrellafonds organisiert. Die konstituierenden Dokumente der Gesellschaft sehen vor, dass die Gesellschaft separate Anteilklassen 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 Anteilkategorie 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 28. Februar 2025 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 29. Februar 2024 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 Jahresabschluss des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], 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 Western Asset Macro Opportunities 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[^], FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth 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[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society 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 ergebniswirksam 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 ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Gewinne und Verluste aus Änderungen des beizulegenden Zeitwerts der Kategorie „Ergebniswirksam 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 ergebniswirksam 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 Wertpapieren der einzelnen Fonds, deren Preise zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden, sind in Erläuterung 12.1 (d) angegeben.

(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) Erlöse 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 wurden sämtliche Beträge als einbringbar ausgewiesen.

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 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.

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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 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 Anteilsinhaber angesehen. Auf diese Weise soll dem Anteilsinhaber 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 Anteilsinhaber 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 Vermögenswerts 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 ergebniswirksam 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 ist dies der US-Dollar, außer beim 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[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 Fund[^], deren funktionale Währung der Euro ist, beim FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], dessen funktionale Währung das Pfund Sterling (Britisches Pfund) ist, und beim Legg Mason Japan Equity Fund[^], dessen funktionale Währung der japanische Yen ist. 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 eingedonnenen 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 Glättstellung 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 Ersteinsschusszahlungen 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 Einschusskonten und Barmitteln mit Verfügungsbeschränkung ausgewiesen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(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.

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 Schuldtitle 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. Zinsszahlungen 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 einen 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 Nominalbetrag 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.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(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.

(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 Unterverwahrstellen 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. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Geschäftsjahres werden im Anlagenportfolio offengelegt.

Die nachstehende Tabelle zeigt die Einnahmen aus umgekehrten Pensionsgeschäften in den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024:

Name des Fonds	28. Februar 2025 (in Tsd.)	29. Februar 2024 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	19.764 \$	14.616 \$

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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

3. Effizientes Portfoliomanagement – (Fortsetzung)

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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 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	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	0,950 %
Klasse B	1,050 %	Klasse B	1,200 %
Klasse C	1,300 %	Klasse C	1,450 %
Klasse E	1,400 %	Klasse E	1,550 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	0,700 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse R	0,550 %
Klasse LM	keine	Klasse T	0,950 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse X	0,450 %
Klasse L(G)	0,800 %	Klasse Premier	0,450 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		Klasse S	0,450 %
Klasse A	0,800 %	Klasse P1	0,300 %
Klasse B	1,050 %	Klasse P2	0,450 %
Klasse C	1,300 %	Klasse LM	keine
Klasse E	1,400 %	Klasse A (G)	1,150 %
Klasse F	0,550 % ¹	Klasse L(G)	1,650 %
Klasse R	0,400 %	Klasse GF	0,950 %
Klasse T	0,800 %	FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse X	0,300 %	Klasse A	0,950 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse B	1,200 %
Klasse S	0,300 %	Klasse C	1,450 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse E	1,550 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse F	0,700 %
Klasse LM	keine	Klasse R	0,850 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse T	0,950 %
Klasse GE	1,420 %	Klasse X	0,450 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		Klasse Premier	0,450 %
Klasse A	1,000 %	Klasse S	0,450 %
Klasse B	1,250 %	Klasse P1	0,300 %
Klasse C	1,500 %	Klasse P2	0,450 %
Klasse E	1,600 %	Klasse LM	keine
Klasse F	0,550 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse R	0,600 %	Klasse L(G)	1,750 %
Klasse T	1,000 %	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse S	0,270 %	Klasse A	1,100 %
Klasse X	0,300 %	Klasse B	1,350 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse C	1,600 %
Klasse P1	0,300 %	Klasse E	1,700 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse F	0,850 %
Klasse LM	keine	Klasse R	0,700 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse T	1,100 %
Klasse B (G)	1,650 %	Klasse X	0,600 %
Klasse L(G)	1,650 %	Klasse Premier	0,600 %
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^]		Klasse S	0,600 %
Klasse A	0,800 %	Klasse P1	0,600 %
Klasse B	1,050 %	Klasse P2	0,600 %
Klasse C	1,300 %	Klasse LM	keine
Klasse E	1,400 %	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse F	0,550 %	Klasse A	0,850 %
Klasse R	0,400 %	Klasse B	1,100 %
Klasse T	0,800 %	Klasse C	1,350 %
Klasse X	0,300 %	Klasse E	1,450 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse F	0,600 %
Klasse S	0,300 %	Klasse R	0,450 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse T	0,850 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse X	0,350 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,350 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse S	0,350 %
Klasse GE	1,420 %	Klasse P1	0,350 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		Klasse P2	0,250 %
Klasse A	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse B	1,350 %		
Klasse C	1,600 %		
Klasse E	1,700 %		
Klasse F	0,650 %		
Klasse R	0,700 %		
Klasse T	1,100 %		
Klasse X	0,550 %		
Klasse Premier	0,400 %		
Klasse S	0,400 %		
Klasse P1	0,400 %		
Klasse P2	0,400 %		
Klasse LM	keine		

¹ Maximale Verwaltungsgebühr für Klasse F ausschüttend (D): 0.400 %.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A	0,900 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,150 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,400 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,500 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,650 %	Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,500 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	0,900 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,400 %	Klasse X	0,600 %
Klasse Premier	0,400 %	Klasse Premier	0,600 %
Klasse S	0,400 %	Klasse S	0,600 %
Klasse P1	0,300 %	Klasse P1	0,600 %
Klasse P2	0,400 %	Klasse P2	0,600 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
Klasse A	0,850 %	Klasse A	1,350 %
Klasse B	1,100 %	Klasse B	1,600 %
Klasse C	1,350 %	Klasse C	1,850 %
Klasse E	1,450 %	Klasse E	1,950 %
Klasse F	0,600 %	Klasse F	1,100 %
Klasse R	0,650 %	Klasse J	0,900 %
Klasse T	0,850 %	Klasse R	0,950 %
Klasse X	0,350 %	Klasse X	0,900 %
Klasse Premier	0,350 %	Klasse Premier	0,900 %
Klasse S	0,350 %	Klasse S	0,900 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse P1	0,900 %
Klasse P2	0,350 %	Klasse P2	0,900 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,750 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	0,750 %
Klasse R	1,100 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	1,500 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	1,000 %	Klasse X	0,550 %
Klasse Y	1,000 %	Klasse Premier	0,550 %
Klasse Premier	1,000 %	Klasse S	0,550 %
Klasse S	1,000 %	Klasse P1	0,550 %
Klasse P1	1,000 %	Klasse P2	0,330 %
Klasse P2	0,600 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		Klasse A	1,150 %
Klasse A	1,250 %	Klasse B	1,400 %
Klasse B	1,500 %	Klasse C	1,650 %
Klasse C	1,750 %	Klasse E	1,750 %
Klasse E	1,850 %	Klasse F	0,900 %
Klasse F	0,800 %	Klasse R	0,750 %
Klasse R	0,750 %	Klasse T	1,150 %
Klasse T	1,250 %	Klasse X	0,650 %
Klasse X	0,625 %	Klasse Premier	0,650 %
Klasse Premier	0,600 %	Klasse S	0,650 %
Klasse S	0,600 %	Klasse P1	0,650 %
Klasse P1	0,600 %	Klasse P2	0,650 %
Klasse P2	0,400 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		Klasse A	1,100 %
Klasse D	1,200 %	Klasse B	1,350 %
Klasse F	1,200 %	Klasse C	1,600 %
Klasse M	0,600 %	Klasse E	1,700 %
Klasse Premier	0,600 %	Klasse F	0,800 %
Klasse S	0,600 %	Klasse J	0,450 %
Klasse P1	0,600 %	Klasse R	0,700 %
Klasse P2	0,600 %	Klasse T	1,100 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,450 %
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		Klasse Premier	0,450 %
Klasse A	1,000 %	Klasse S	0,450 %
Klasse B	1,250 %	Klasse P1	0,450 %
Klasse C	1,500 %	Klasse P2	0,350 %
Klasse E	1,600 %	Klasse LM	keine
Klasse F	0,550 %	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]	
Klasse R	0,600 %	Klasse A	1,650 %
Klasse X	0,500 %	Klasse B	1,900 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse C	2,150 %
Klasse S	0,300 %	Klasse E	2,250 %
Klasse P1	0,300 %	Klasse F	1,300 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse J	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse R	1,250 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]		Klasse T	1,650 %
Klasse LM	keine	Klasse X	1,150 %
		Klasse Premier	1,150 %
		Klasse S	1,150 %
		Klasse P1	0,750 %
		Klasse P2	1,150 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse A	2,000 %	Klasse A	1,300 %
Klasse T	2,000 %	Klasse B	1,800 %
Klasse X	1,150 %	Klasse C	1,800 %
Klasse Premier	1,150 %	Klasse E	2,050 %
Klasse S	1,000 %	Klasse F	1,050 %
Klasse P1	1,150 %	Klasse R	0,800 %
Klasse P2	1,150 %	Klasse T	1,300 %
Klasse LM	keine	Klasse X	0,650 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		Klasse Premier	0,650 %
Klasse A	1,100 %	Klasse S	0,650 %
Klasse B	1,350 %	Klasse P1	0,650 %
Klasse C	1,600 %	Klasse P2	0,650 %
Klasse E	1,700 %	Klasse LM	keine
Klasse F	0,800 %	Klasse A (G)	1,300 %
Klasse J	0,450 %	Klasse B (G)	1,800 %
Klasse R	0,700 %	Klasse L(G)	1,800 %
Klasse T	1,100 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse X	0,550 %	Klasse GE	2,170 %
Klasse Premier	0,550 %	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse S	0,550 %	Klasse A	1,250 %
Klasse P1	0,350 %	Klasse B	1,750 %
Klasse P2	0,550 %	Klasse C	1,750 %
Klasse LM	keine	Klasse E	2,000 %
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		Klasse F	1,000 %
Klasse A	0,800 %	Klasse R	0,800 %
Klasse B	1,050 %	Klasse T	1,250 %
Klasse C	1,300 %	Klasse X	0,625 %
Klasse E	1,400 %	Klasse Premier	0,625 %
Klasse F	0,550 %	Klasse S	0,625 %
Klasse R	0,600 %	Klasse P1	0,625 %
Klasse T	0,800 %	Klasse P2	0,625 %
Klasse X	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,300 %	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]	
Klasse S	0,300 %	Klasse A	1,200 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse B	1,700 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse C	1,700 %
Klasse LM	keine	Klasse E	1,950 %
FTGF ClearBridge US Value Fund		Klasse F	0,950 %
Klasse A	1,350 %	Klasse R	0,700 %
Klasse B	1,850 %	Klasse T	1,200 %
Klasse C	1,850 %	Klasse X	0,600 %
Klasse E	2,100 %	Klasse Premier	0,600 %
Klasse F	1,100 %	Klasse S	0,500 %
Klasse R	0,850 %	Klasse P1	0,500 %
Klasse T	1,350 %	Klasse P2	0,400 %
Klasse X	0,675 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,675 %	FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^]	
Klasse S	0,525 %	Klasse A	1,300 %
Klasse P1	0,675 %	Klasse B	1,800 %
Klasse P2	0,675 %	Klasse C	1,800 %
Klasse LM	keine	Klasse E	2,050 %
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		Klasse F	1,050 %
Klasse A	1,250 %	Klasse R	0,800 %
Klasse B	1,750 %	Klasse T	1,300 %
Klasse C	1,750 %	Klasse X	0,650 %
Klasse E	2,000 %	Klasse Premier	0,650 %
Klasse F	1,000 %	Klasse S	0,650 %
Klasse R	0,750 %	Klasse P1	0,550 %
Klasse T	1,250 %	Klasse P2	0,650 %
Klasse X	0,625 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,625 %	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Klasse S	0,625 %	Klasse A	1,500 %
Klasse P1	0,625 %	Klasse B	2,000 %
Klasse P2	0,625 %	Klasse C	2,000 %
Klasse LM	keine	Klasse E	2,250 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse L(G)	1,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse X	0,750 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse Premier	0,750 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		Klasse S	0,600 %
Klasse A	1,250 %	Klasse P1	0,750 %
Klasse B	1,750 %	Klasse P2	0,750 %
Klasse C	1,750 %	Klasse LM	keine
Klasse E	2,000 %		
Klasse F	1,000 %		
Klasse R	0,750 %		
Klasse T	1,250 %		
Klasse X	0,625 %		
Klasse Premier	0,625 %		
Klasse S	0,525 %		
Klasse P1	0,625 %		
Klasse P2	0,625 %		
Klasse LM	keine		
Klasse A (G)	1,250 %		
Klasse L(G)	1,750 %		
Klasse GA	1,420 %		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income 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	0,600 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P2	0,400 %	Klasse P1	0,440 %
Klasse LM	keine	Klasse P2	0,750 %
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]		Klasse LM	
Klasse A	1,300 %		keine
Klasse B	1,800 %	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Klasse C	1,800 %	Klasse A	1,500 %
Klasse E	2,050 %	Klasse B	2,000 %
Klasse F	1,050 %	Klasse C	2,000 %
Klasse R	0,800 %	Klasse E	2,250 %
Klasse T	1,300 %	Klasse F	1,250 %
Klasse X	0,650 %	Klasse J	0,650 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse R	1,000 %
Klasse S	0,650 %	Klasse T	1,500 %
Klasse P1	0,650 %	Klasse X	0,750 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,750 %
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		Klasse P1	0,750 %
Klasse A	1,500 %	Klasse P2	0,650 %
Klasse B	2,000 %	Klasse LM	keine
Klasse C	2,000 %	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Klasse E	2,250 %	Klasse A	1,500 %
Klasse F	1,250 %	Klasse B	2,000 %
Klasse R	1,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse E	2,250 %
Klasse X	0,750 %	Klasse F	1,250 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse S	0,600 %	Klasse X	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse P2	0,750 %	Klasse S	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse P1	0,650 %
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		Klasse P2	0,750 %
Klasse A	1,500 %	Klasse LM	keine
Klasse B	2,000 %	FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Klasse C	2,000 %	Klasse A	1,500 %
Klasse E	2,250 %	Klasse B	2,000 %
Klasse F	1,250 %	Klasse C	2,000 %
Klasse R	1,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse T	1,500 %	Klasse F	1,250 %
Klasse X	0,750 %	Klasse R	1,000 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse S	0,750 %	Klasse X	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse P2	0,750 %	Klasse S	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse P1	0,650 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse P2	0,750 %
Klasse L(G)	1,750 %	Klasse LM	keine
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	0,60 %
Klasse B	2,000 %	Klasse D	1,15 %
Klasse C	2,000 %	Klasse K	0,60 %
Klasse E	2,250 %	Klasse X	0,20 %
Klasse F	1,250 %	Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]	
Klasse R	1,000 %	Klasse A	0,60 %
Klasse T	1,500 %	Klasse D	1,15 %
Klasse X	0,750 %	Klasse K	0,60 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse X	0,20 %
Klasse S	0,750 %		
Klasse P1	0,550 %		
Klasse P2	0,750 %		
Klasse LM	keine		
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]			
Klasse A	1,500 %		
Klasse B	2,000 %		
Klasse C	2,000 %		
Klasse E	2,250 %		
Klasse F	1,250 %		
Klasse R	1,000 %		
Klasse T	1,500 %		
Klasse X	0,750 %		
Klasse Premier	0,750 %		
Klasse S	0,750 %		
Klasse P1	0,750 %		
Klasse P2	0,650 %		
Klasse LM	keine		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsvergütungen 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 endenden Geschäftsjahre wurden folgende Verwaltungsvergütungen erlassen bzw. erstattet und sonstige Aufwendungen rückerlangt:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)		Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsvergütungen	Erstattete Verwaltungsvergütungen und sonstige rückerlangte Aufwendungen	Erlassene Verwaltungsvergütungen	Erstattete Verwaltungsvergütungen und sonstige rückerlangte Aufwendungen
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	– \$	18 \$	– \$	56 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	5 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	1 €	15 €	– €	– €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	13 \$	6 \$	2 \$	1 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	8 \$	8 \$	1 \$	1 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	11 \$	– \$	8 \$	– \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	15 \$	– \$	2 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	3 \$	– \$	10 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	26 \$	44 \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$	– \$	9 \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	– \$	75 \$	– \$	66 \$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	– \$	– \$	20 \$	33 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	44 \$	– \$	49 \$	8 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	1 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	68 \$	2 \$	57 \$	11 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	– \$	10 \$	– \$	27 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	44 \$	14 \$	54 \$	16 \$
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	24 \$	– \$	19 \$	1 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	31 \$	– \$	46 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	31 \$	– \$	41 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	19 \$	33 \$	7 \$	23 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	33 \$	13 \$	31 \$	41 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	– \$	1 \$	38 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	– \$	– \$	1 \$	15 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	18 \$	– \$	19 \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	2 \$	26 \$	11 \$	13 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	51 \$	– \$	52 \$	– \$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	27 €	– €	2 €	– €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	6 \$	69 \$	4 \$	71 \$
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	23 €	– €	10 \$	– €
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	22 €	– €	– €	– €

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 Untereinverwalter 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 von der Verwaltungsgesellschaft ordnungsgemäß zu zahlen sind oder 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 „Informationsstellengebühr“). Gemäß dem Haupt-Informationsstellenvertrag 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-Informationsstellenvertrags 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 des 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 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 Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] und FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]
- 0,35 % p.a. des Nettoinventarwerts des FTGF ClearBridge US 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 Leaders 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[^].

Die Informationsstellengebühren sind für alle Anteilsklassen zahlbar, mit Ausnahme der Anteilsklassen F, Anteilsklassen J, Anteilsklassen P1 und Anteilsklasse P2, Anteilsklassen Y, Anteilsklassen Premier, Anteilsklassen S, Anteilsklassen LM und Grandfathered Anteilsklassen (jeweils wie im Prospekt definiert). Ebenfalls nicht zahlbar sind diese für alle Anteilsklassen, die vom FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] und Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] angeboten werden.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

In den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 wurden folgende Informationsstellengebühren erlassen:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.) Erlassene	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.) Erlassene
	Informationsstellengebühren	Informationsstellengebühren
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	19 \$	8 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	22 \$	3 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	3 \$	1 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	32 \$	5 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	47 \$	35 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	1 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	4 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	12 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	2 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	3 \$	4 \$
FTGF ClearBridge US Value Fund	226 \$	– \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	55 \$	7 \$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	21 \$	– \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	38 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	34 \$	33 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	217 \$	96 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	2 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	64 \$	2 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	14 \$	16 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	– \$	2 \$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	– \$	\$ 1
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	28 \$	8 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	16 \$	41 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	6 \$	7 \$
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	4 \$	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 28. Februar 2025 beliefen sich diese Aufwendungen auf 1.019.558 USD (29. Februar 2024: 1.037.845 USD).

Verbundene Parteien

Verwaltungsrats honorare sind nicht zahlbar für Jaspal Saggar, Craig Tyle und Elinor Murray, die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind. Mit Wirkung vom 30. August 2024 wurde Jaspal Saggar als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat von FTIS bestellt. 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 28. Februar 2025 und zum 29. Februar 2024 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die dieselben Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie die Fonds oder eine verbundene Partei dieser Verwalter, 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	28. Februar 2025 % Wert (in Tsd.)		29. Februar 2024 % Wert (in Tsd.)	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,16 %	4.044 \$	0,12 %	3.108 \$
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 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	13,34 %	3.211 \$	10,61 %	3.139 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	882 \$	0,02 %	577 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,22 %	5.439 \$	0,22 %	5.476 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,18 %	4.433 \$	0,04 %	1.097 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3,15 %	7.610 \$	2,92 %	10.594 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	5,49 %	1.322 \$	4,37 %	1.292 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	1.392 \$	0,00 %	69 \$
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 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,22 %	5.530 \$	0,85 %	21.501 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3,09 %	77.894 \$	0,69 %	17.502 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.645 \$	0,01 %	133 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	1.367 \$	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)	0,16 %	4.102 \$	0,32 %	8.090 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,12 %	2.994 \$	0,03 %	718 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,22 %	5.563 \$	0,14 %	3.580 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,23 %	30.962 \$	0,81 %	20.461 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	470 \$	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 \$

[^] 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	28. Februar 2025 % Wert (in Tsd.)	29. Februar 2024 % Wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	742 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,31 %	33.129 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.811 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	122 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	198 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	–	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	5 \$

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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	28. Februar 2025 (in Tsd.)	29. Februar 2024 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	30 \$	31 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	139 \$	192 \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	– €	8 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	7 \$	5 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	\$ 1	1 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	– \$	– \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	2 \$	8 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	10 \$	18 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	8 \$	12 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	2 \$	3 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	– \$	6.442 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	\$ 25	25 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	12 \$	8 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	24 \$	38 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	8 \$	10 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	– \$	15 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	9 \$	8 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	\$ 1	1 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	– \$	15 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	35 \$	74 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	– \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	– \$	8 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	– \$	\$ 1
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	2 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Value Fund	348 \$	350 \$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	8 \$	6 \$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	55 \$	31 \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	13 \$	11 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	\$ 5	5 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	85 \$	111 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	23 \$	9 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	528 €	777 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	373 \$	453 \$
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	4 \$	11 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	2.104 \$	1.161 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	87 \$	94 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	5 \$	4 \$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	63 \$	99 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	– \$	18 \$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	35 \$	22 \$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	112 €	81 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	17 \$	8 \$

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 £.

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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 fielen keine Performancegebühren an, 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 28. Februar 2025 beziehenden ergebniswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 170.000 USD (29. Februar 2024: 198.000 \$).

Verwaltungsrats honorare sind nicht zahlbar für Jaspal Saggar, Craig Tyle und Elinor Murray, die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind.

Prüfungshonorar

Die an den Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, für das Geschäftsjahr gezahlten Honorare in Höhe von 1.019.700 € (ohne MwSt.) beziehen sich auf die gesetzliche Prüfung des Jahresabschlusses der Gesellschaft (29. Februar 2024): 1.017.115 € (ohne MwSt.). Das gesamte Prüfungshonorar für die Gesellschaft, wie in der Gesamtergebnisrechnung auf Seite 168 aufgeführt, enthält die Mehrwertsteuer in Höhe von 23 % und ist in der Berichtswährung der Gesellschaft (US-Dollar) angegeben.

[^] 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

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 beliefen sich die gezahlten Auslagen des Abschlussprüfers auf 12.600 € (29. Februar 2024: 12.100 €).

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

Fonds	Beteiligung in % 28. Februar 2025	Beteiligung in % 29. Februar 2024
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	77,26	75,72
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	28,30	21,36
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	21,92	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	–	82,67
FTGF Western Asset US High Yield Fund	40,24	30,69
FTGF Western Asset US High Yield Fund	33,59	20,49
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	46,49	34,37
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	–	23,37
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	35,35	23,69
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	30,66	26,95
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	30,32	25,55
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	–	22,55
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^	84,20	66,32
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	66,56	70,85
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	32,03	25,18
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	30,04	31,37
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	93,06	83,11
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^	95,12	94,53
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund^	96,88	97,99
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	64,35	56,37
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	40,37	39,29
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	–	28,61
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	59,35	52,74
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	22,15	–
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	33,06	29,66
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	22,18	28,30
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	52,03	45,98
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^	–	22,36
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	–	91,03
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^	–	100,00
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^	90,64	100,00
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	36,08	31,30
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	–	36,64
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	–	26,41
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	28,09	27,17
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	47,99	39,28
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	38,71	54,35
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	34,09	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	–	28,64
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	27,29	28,16
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	21,07	22,33
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	100,00	100,00
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	33,48	44,03
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	99,98	99,91
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	61,51	57,00
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	–	20,19
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	54,30
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	25,32
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	31,38	31,20
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	–	25,70
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	33,72	25,22
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	30,08	24,33
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	21,69	20,19
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	39,60	83,18
Franklin Responsible Income 2028 Fund^	36,83	36,32
Franklin Responsible Income 2029 Fund^	27,90	–

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 Anteilsinhaber jeder ausschüttenden Anteilsklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilsinhaber verlangt etwas anderes.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse 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 Anteilsinhaber jeder ausschüttenden Anteilsklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilsinhaber verlangt etwas anderes.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital beschließen und zahlen. Die Anleger dieser Anteilsklassen werden darauf hingewiesen, 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 pro Anteil der Anteilsklasse führen. 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 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	59 \$	47 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	4 \$	9 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	43 \$	19 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	5 \$	3 \$
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	20 \$	16 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.672 \$	152 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	57 \$	29 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1 \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	47 \$	9 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	110 \$	109 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	112 \$	108 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	48 \$	42 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	610 \$	742 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	250 \$	325 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	879 \$	273 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	127 \$	159 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	34 \$	61 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	9 \$	11 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ – Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	1 \$	3 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	5 \$	3 –
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	277 \$	434 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	12 \$	22 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	15 \$	16 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	17 \$	20 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	17 \$	29 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	79 \$	125 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	305 \$	482 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	30 \$	55 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	60 \$	60 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	23 \$	22 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	3 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	5 \$	4 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	9 \$	8 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.137 €	1.909 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	114 €	– €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	67 €	91 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	431 €	867 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	80 €	121 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	113 €	156 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1.124 \$	1.335 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	173 \$	160 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	39 \$	38 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	187 \$	173 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	142 \$	122 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	17 \$	26 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.429 \$	1.363 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	1.759 \$	965 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	104 \$	71 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	– \$	7 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	– \$	5 \$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^ – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	– \$	4 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^ – Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus	3 \$	8 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^ – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	– \$	1 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^ – Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	– \$	5 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^ – Klasse D AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	– \$	2 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^ – Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1 \$	4 \$

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. Anteilsinhaber 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. 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 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (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 \$

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	194 \$	138 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	42 \$	24 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	794 \$	520 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	847 \$	1.965 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	99 \$	221 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	13 \$	31 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	30 \$	81 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	61 \$	136 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	3 \$	2 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	147 \$	374 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	18 \$	87 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	8 \$	19 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	81 \$	201 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
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)	1.117 \$	1.265 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	404 \$	436 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	69 \$	82 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	305 \$	231 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	99 \$	113 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	43 \$	99 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	14 \$	29 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	75 \$	103 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	152 \$	226 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1 \$	17 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	10 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20 \$	22 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	159 \$	125 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	\$ 1	1 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	391 €	383 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	26 €	37 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	758 \$	1.068 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	– \$	2 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	15 \$	69 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	7 \$	14 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	3 \$	3 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	36 \$	17 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	2 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	1 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	7 \$	1 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	19 \$	3 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	23 \$	90 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)	2 \$	8 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)	1 \$	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 gewinnberechtignte 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 gewinnberechtignte 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 Anteilinhaber 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 Anteilinhaber 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 Anteilklasse wird als ausschüttende Anteilklasse oder als thesaurierende Anteilklasse bezeichnet. Thesaurierende Anteilklassen schütten keine Nettoerträge, realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus, während ausschüttende Anteilklassen in bestimmten Abständen Ausschüttungen vornehmen, die je nach dem Buchstaben in Klammern am Ende des Namens der ausschüttenden Anteilklasse 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 Anteilklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Für jede derartige Anteilklasse werden der betreffende Anlageverwalter und der Unteranlageverwalter keine Techniken zur Absicherung des Risikos der Anteilklasse in Bezug auf Wechselkursänderungen zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilklasse anwenden, es sei denn, dies ist im Namen der Anteilklasse 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 Klasse AX stehen allen Anlegern zur Verfügung. Nach der jeweiligen Erstzeichnungsfrist entspricht der Zeichnungspreis je Anteil dem nächstfolgend ermittelten NIW je Anteil zuzüglich eines Ausgabeaufschlags von bis zu 1,5 %. Anteile der Klassen B, C, D, E und K stehen allen Anlegern zur Verfügung, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle für 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. Beim FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund stehen Anteile der Klasse M professionellen Anlegern und Anlegern zur Verfügung, die mit einem Händler oder einer anderen von einer Vertriebsstelle für diese Anteile bestellten Stelle eine Vereinbarung über die Anlage dieser Anteile nach eigenem Ermessen getroffen haben. Bei allen Fonds stehen Anteile der Klasse M professionellen Anlegern, Plattformen, die keine Vertriebsprovisionen annehmen und einbehalten dürfen, sowie Anlegern, die mit einem Händler oder einer anderen von einer Vertriebsstelle für diese Anteile bestellten Stelle eine Vereinbarung über die Anlage nach eigenem Ermessen getroffen haben, zur Verfügung. 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 S (vormals Klasse U, umbenannt am 31. Mai 2024) stehen einem Anleger zur Verfügung, der eine Mindestanlage von mindestens 50.000.000 USD in den betreffenden Teilfonds tätigt, es sei denn, der Anleger erfüllt eines der folgenden Kriterien: i) insgesamt mindestens 1.000.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung), die in Organismen für gemeinsame Anlagen von Franklin Templeton, die in der EU domiziliert sind, investiert sind oder für die (mittels einer Absichtserklärung) eine Verpflichtung eingegangen wurde; und/oder ii) insgesamt mindestens 5.000.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung) an Vermögenswerten, die von Franklin Templeton global verwaltet werden oder für die (im Rahmen einer Absichtserklärung) eine entsprechende Verpflichtung besteht; wobei die unter i) oder ii) genannten zulässigen institutionellen Anleger keine Provisionen, Rabatte oder andere ähnliche Gebühren (als Anreize bezeichnet) erhalten und einbehalten dürfen. 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. Anteile der Klasse Y 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.

Bezüglich der Klasse P1 (verfügbar seit 31. Mai 2024) ist beabsichtigt, sofern in dem betreffenden Nachtrag nicht anders angegeben, dass der Verwaltungsrat für eine begrenzte Dauer Anträge von institutionellen Anlegern akzeptiert, die mindestens 10.000.000 USD für Anteile der Klasse P1 investieren, bis der Gesamt-Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse(n) des Fonds (ohne Seed-Kapital) den Wert von 100.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung) oder einen anderen Wert, wie ausdrücklich festgelegt und auf der Franklin Templeton Website veröffentlicht, erreicht. Bezüglich der Klasse P2 (verfügbar seit 31. Mai 2024) ist beabsichtigt, sofern in dem betreffenden Nachtrag nicht anders angegeben, dass der Verwaltungsrat für eine begrenzte Dauer Anträge von institutionellen Anlegern, Intermediären, Vertriebsgesellschaften, Plattformen und/oder Brokern/Händlern akzeptiert, die mindestens 5.000.000 USD für Anteile der Klasse P2 investieren, bis der Gesamt-Nettoinventarwert der betreffenden Anteilklasse(n) des Fonds (ohne Seed-Kapital) den Wert von 200.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung) oder einen anderen Wert, wie ausdrücklich vom Manager festgelegt und auf der Franklin Templeton Website veröffentlicht, erreicht.

Für Anteilklassen, die in ihrem Namen nach der Währungsbezeichnung den Zusatz „(Abgesichert)“ enthalten, ist vorgesehen, dass diese Anteilsklassen gegen Wechselkursschwankungen zwischen der Währung der Anteilklasse 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 Anteilklasse 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 Anteilklasse angezeigt wird. Bestimmte Fonds bieten Anteilsklassen an, die eine Performancegebühr zahlen können, was durch „(PF)“ im Namen der Anteilklasse angezeigt wird. Für bestimmte Anteilsklassen des FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund steht eine selektiv abgesicherte Anteilklasse zur Verfügung, was durch „(SH)“ im Namen der Anteilklasse angezeigt wird.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile von Grandfathered-Anteilsklassen ausgegeben, was durch „GA“, „GE“, „GP“ oder „(G)“ im Namen der Anteilklasse 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 Anteilklasse als auch durch neue Anleger geschlossen, mit der Ausnahme, dass Anteile weiterhin durch -1 die Wiederanlage von Dividenden, -2 den automatischen Umtausch von einer Anteilklasse der Klasse B (G) des Fonds in eine Anteilklasse der Klasse A (G) desselben Fonds und -3 den Umtausch von Anteilen einer Grandfathered-Anteilklasse 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 Anteilklasse 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 Steuertatbestands 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 Steuertatbestands 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. Zum 28. Februar 2025 wurden Einschusszahlungen und Barsicherheiten in Bezug auf den Handel mit OTC- und börsengehandelten Derivaten bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNY, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS (29. Februar 2024: Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, BNY, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS).

9. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 28. Februar 2025 bzw. 29. Februar 2024 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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

10. Soft-Commission-Vereinbarungen – (Fortsetzung)

wird. Diese Kosten werden von dem jeweiligen Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen über die Ausführungsrichtlinien der Fonds stehen den Anteilseignern auf Anfrage kostenlos zur Verfügung.

Während der Geschäftsjahre zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 schloss Royce & Associates, LP („Royce“) Soft-Commission-Verträge mit Brokern, erstattete den betreffenden Fonds jedoch die im Rahmen dieser Verträge angefallenen Research-Kosten.

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 28. Februar 2025	Wechselkurse zum 29. Februar 2024
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	1.221,8909*	1.059,2180*
	Australischer Dollar	1,6116	1,5385
	Brasilianischer Real	5,8877	4,9711
	Britisches Pfund	0,7950	0,7922
	Kanadischer Dollar	1,4468	1,3572
	Chinesischer Renminbi (CNH)	7,2952	7,2064
	Chinesischer Renminbi (CNY)	7,2832	7,1933
	Kolumbianischer Peso	4.153,8200	3.925,0000
	Tschechische Krone	24,1842	23,4451
	Dänische Krone	7,1894	6,8965
	Dominik. Peso	/	58,6500
	Ägyptisches Pfund	50,6500	42,2500
	Euro	0,9640	0,9252
	Hongkong-Dollar	7,7771	7,8295
	Ungarischer Forint	388,4419	363,2263
	Indische Rupie	87,5038	82,9163
	Indonesische Rupiah	16.580,0000	15.715,0000
	Jamaika-Dollar	157,5000	155,9966
	Japanischer Yen	150,5350	149,9200
	Malaysischer Ringgit	4,4625	4,7455
	Mexikanischer Peso	20,5540	17,0443
	Neuseeland-Dollar	1,7868	1,6424
	Norwegische Krone	11,2633	10,6213
	Philippinischer Peso	57,9925	56,2150
	Polnischer Zloty	4,0452	3,9931
	Russischer Rubel	89,3750	91,5000
	Saudi-Rial	3,7503	3,7503
	Singapur-Dollar	1,3515	1,3456
	Südafrikanischer Rand	18,7100	19,1800
	Südkoreanischer Won	1.462,9000	1.331,6000
	Schwedische Krone	10,7671	10,3664
	Schweizer Franken	0,9030	0,8844
	Taiwan-Dollar	32,8125	31,6095
	Thailändischer Baht	34,1725	35,8650
	Türkische Lira	36,4848	31,2315
	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	3,6728	3,6730
	Uruguayischer Peso	/	39,1450
Auf EUR lautende Fonds		Wechselkurse zum 28. Februar 2025	Wechselkurse zum 29. Februar 2024
	Australischer Dollar	1,6718	1,6628
	Brasilianischer Real	6,1076	5,3728
	Britisches Pfund	0,8247	0,8562
	Kanadischer Dollar	1,5008	1,4668
	Dänische Krone	7,4579	7,4537
	Japanischer Yen	/	162,0336
	Norwegische Krone	/	11,4795
	Polnischer Zloty	/	4,3157
	Südafrikanischer Rand	/	20,7298
	Schwedische Krone	11,1693	11,2040
	Schweizer Franken	0,9367	0,9558
	US-Dollar	1,0374	1,0808
Auf GBP lautende Fonds		Wechselkurse zum 28. Februar 2025	Wechselkurse zum 29. Februar 2024
	US-Dollar	1,2579	1,2623

* Abgezinster 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 Gegenparteirisiko, 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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

Wertpapiere können ebenfalls einem Zinsrisiko unterliegen, inwieweit in geringerem Umfang. Von der Verwahrstelle verwaltete Barmittel können Zinseinnahmen generieren, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinssätzen schwankt.

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. Rentenfond 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 Aktienleiherträge 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 den 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 überprüfen, 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 (außer der 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 und FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]) wendet den Commitment-Ansatz an. Der 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 und FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] wenden den VaR-Ansatz an. Der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] and FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] haben bis zur Einstellung des Handels am 17. Juli 2024, 29. Oktober 2024 bzw. 19. Dezember 2024 den VaR-Ansatz angewendet.

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 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 oder wandten (bis zum Datum ihrer Schließung) ein „absolutes“ VaR-Modell, an bei dem die Messung des VaR relativ zum Nettoinventarwert des Fonds erfolgt. 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 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	/	2,36 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	0,71 %	1,10 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	0,30 %	0,81 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	0,96 %	1,47 %

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 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	0,55 %	0,77 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	0,48 %	0,62 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	0,30 %	0,50 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	/	1,23 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	/	0,61 %

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 oder wandten (bis zum Datum ihrer Schließung) ein „absolutes“ VaR-Modell gemäß den Vorschriften der Zentralbank an, wobei jeder dieser Fonds einer absoluten VaR-Grenze von 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds unterliegt oder unterlag. Bei jedem dieser Fonds kann jedoch von Zeit zu Zeit eine Veränderung des Nettoinventarwerts über einen Zeitraum von 20 Tagen von mehr als 20 % des Nettoinventarwerts eintreten bzw. eingetreten sein (bis zum Datum ihrer Schließung).

Neben der Anwendung des VaR-Ansatzes überwacht oder überwachte (bis zum Datum der Schließung) 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[^] den Grad der Hebelung täglich, um Veränderungen aufgrund von Marktentwicklungen festzustellen. 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.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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 28. Februar 2025

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	3,15 %	9,21 %	12,58 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	3,24 %	4,12 %	5,26 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	1,34 %	2,19 %	3,96 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	4,52 %	5,89 %	7,24 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	2,66 %	4,28 %	6,89 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	2,85 %	3,54 %	4,70 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	1,89 %	2,58 %	3,79 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	0,94 %	7,90 %	8,83 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	0,04 %	3,43 %	4,48 %

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 %

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 28. Februar 2025	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	966,85 % *	1.522,96 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	58,36 %	95,37 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	23,06 %	24,33 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	277,34 %	415,50 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	153,57 %	191,10 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	31,71 %	64,20 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	6,86 %	72,85 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	104,95 % *	130,53 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	36,42 % *	74,62 %

* Bis zu dem Datum, an dem der jeweilige Fonds den Handel eingestellt hat.

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. Für die Zwecke dieses Jahresberichts wird dementsprechend die monetäre Auswirkung eines spontanen Anstiegs der kurzfristigen Zinssätze um 25 Basispunkte auf den FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund dargestellt:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Zum 28. Februar 2025	-379.240 \$
Zum 29. Februar 2024	-223.701 \$

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko jedes Fonds in Bezug auf einen Index wird überwacht, jedoch nicht gemanagt. Die Indizes zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 sind umseitig aufgeführt.

In den folgenden Tabellen ist für jeden Fonds der Index angegeben, außer für den FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund und FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], ebenso wie die wahrscheinliche Auswirkung auf den Wert des Nettoinventarwerts für jeden Fonds auf der Grundlage positiver und negativer Entwicklungen im Index, einschließlich des 1-Jahres-Betas 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 28. Februar 2025

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	28.210	-28.210
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	5.427	-5.427
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	13.628	-13.628
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	50 % Bloomberg Global Aggregate Index (Gross-Hedged) (USD) / 25 % Bloomberg US Corporate High Yield Index (Gross) (USD) / 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Gross) (USD), davor ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	10.937	-10.937
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	4.571	-4.571
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	2.417	-2.417
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	9.048	-9.048
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund ***	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	4261	-4.261
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	7.302	-7.302

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 % *	Negativ 5 % *
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	1.344	-1.344
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	61.637	-61.637
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index (CH in USD), davor FTSE World Govt Bond Index (USD)	USD	4.330	-4.330
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index	USD	1.795	-1.795
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	13.141	-13.141
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Bloomberg U.S. Aggregate	USD	2.248	-2.248
FTGF ClearBridge US Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	56.554	-56.554
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	9.081	-9.081
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	90.390	-90.390
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell Midcap Growth NR (USD), davor Russell 3000 Growth (USD) Index	USD	5.866	-5.866
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.081	-1.081
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Russell 3000 Index	USD	45.373	-45.373
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	MSCI AC World Net Index	USD	1.467	-1.467
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	34.101	-34.101
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	31.732	-31.732
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	MSCI World Value Net Index	USD	276	-276
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	50.524	-50.524
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.159	-4.159
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	252	-252
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC World Net Index	USD	1383	-1.383
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.474	-1.474
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	MSCI Europe Net Index	EUR	5.229	-5.229
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	4.052	-4.052
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^] ****	Benchmark nicht verfügbar	EUR	/	/

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

** Benchmark – nicht relevant. Daher steht für den Fonds keine Beta-Historie zur Verfügung.

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

**** Für den Fonds liegt keine 1-Jahres-Performance vor, daher ist das Beta für den Fonds nicht verfügbar.

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition 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 US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.581	-4.581
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	4.325	-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.

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

Die Sensitivitätsanalyse für das Marktpreisrisiko für den FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde), 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^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde) und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde) wurde in die Berechnung des Marktrisikos unter Anwendung des VaR-Ansatzes einbezogen (Erläuterung 12.1 oben).

(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 Wechselkurschwankungen 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 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 28. Februar 2025

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	\$ 1.018.211	\$ 687.039	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -24.494	\$ 1.680.756
Gesamt	\$ 1.018.211	\$ 687.039	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -24.494	\$ 1.680.756
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
US-Dollar	\$ 67.113	\$ 27.824	\$ 4.044	\$ –	\$ 393	\$ -1.472	\$ 97.902
Gesamt	\$ 67.113	\$ 27.824	\$ 4.044	\$ –	\$ 393	\$ -1.472	\$ 97.902
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.153	\$ –	\$ 77	\$ 2230
Brasilianischer Real	2.662	–	–	-2.731	–	87	18
Britisches Pfund	–	–	–	-1.501	5	263	-1.233
Kanadischer Dollar	–	–	–	426	–	122	548
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.656	–	158	-2.498
Euro	–	–	–	-1.094	–	284	-810
Indische Rupie	1.652	–	–	-1.682	–	48	18
Japanischer Yen	–	–	–	304	86	194	584
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	25	25
Mexikanischer Peso	–	–	–	-88	–	247	159
Schweizer Franken	–	–	–	-1	–	–	-1
US-Dollar	174.156	59.976	–	6.806	671	8.124	249.733
Gesamt	\$ 178.470	\$ 59.976	\$ –	\$ -64	\$ 762	\$ 9.629	\$ 248.773

^ 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 45.552	\$ –	\$ –	\$ 45.552
Brasilianischer Real	1.684	–	–	–	–	25	1.709
Britisches Pfund	9.979	11.236	–	-21.603	38	1.780	1.430
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	2	2
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.392	–	–	-2.392
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	74	74
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	35	35
Euro	20.689	7.158	–	-24.923	-208	682	3.398
Indische Rupie	2.076	–	–	-2.338	–	69	-193
Indonesische Rupiah	2.391	–	–	–	–	44	2.435
Japanischer Yen	–	–	–	4.046	–	–	4.046
Mexikanischer Peso	4.657	–	–	-3.092	–	398	1.963
Polnischer Zloty	3.983	–	–	672	–	78	4.733
Singapur-Dollar	–	–	–	717	–	–	717
Südafrikanischer Rand	2.957	–	–	23.762	–	-1.470	25.249
Schweizer Franken	–	–	–	59.528	–	-1	59.527
Taiwan-Dollar	–	–	–	-3.025	–	–	-3.025
US-Dollar	115.198	34.852	3.211	-77.361	-300	20.463	96.063
Gesamt	\$ 163.614	\$ 53.246	\$ 3.211	\$ -457	\$ -470	\$ 22.179	\$ 241.323
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 13	\$ –	\$ –	\$ 13
Euro	–	–	–	1.347	–	–	1.347
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	-1	-1
Singapur-Dollar	–	–	–	2.909	–	-173	2.736
US-Dollar	70.788	16.390	957	-4.264	60	-1.073	82.858
Gesamt	\$ 70.788	\$ 16.390	\$ 957	\$ 5	\$ 60	\$ -1.247	\$ 86.953
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.433	\$ –	\$ 2	\$ 3.435
Britisches Pfund	506	553	–	-39	–	220	1.240
Euro	2.254	105	–	2.291	–	62	4.712
Hongkong-Dollar	–	–	2	–	–	-1	1
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	43	43
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	70	70
Singapur-Dollar	–	–	–	1.369	–	–	1.369
US-Dollar	30.120	6.899	186	-7.080	92	-298	29.919
Gesamt	\$ 32.880	\$ 7.557	\$ 188	\$ -26	\$ 92	\$ 98	\$ 40.789
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 8.285	\$ –	\$ 17	\$ 8.302
Chinesischer Renminbi	37.739	–	–	28.712	–	934	67.385
Euro	–	–	–	3.487	–	–	3.487
Indische Rupie	23.779	–	–	–	–	358	24.137
Indonesische Rupiah	13.847	–	–	–	–	86	13.933
Malaysischer Ringgit	28.627	–	–	–	–	319	28.946
Philippinischer Peso	12.881	–	–	–	–	86	12.967
Singapur-Dollar	9.445	7.592	–	6.992	–	251	24.280
Südkoreanischer Won	26.776	–	–	-2.973	21	811	24.635
Schweizer Franken	–	–	–	15	–	–	15
Thailändischer Baht	18.332	–	–	–	–	95	18.427
US-Dollar	6.241	–	5.439	-44.605	–	-630	-33.555
Gesamt	\$ 177.667	\$ 7.592	\$ 5.439	\$ -87	\$ 21	\$ 2.327	\$ 192.959
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Britisches Pfund	\$ 19.424	\$ 4.903	\$ –	\$ 45.555	\$ –	\$ 1.293	\$ 71.175
Euro	76.048	8.432	–	-75.791	140	1.945	10.774
Japanischer Yen	–	–	–	-243	–	192	-51
Schwedische Krone	–	–	–	5.735	–	56	5.791
Schweizer Franken	–	–	–	4.405	–	165	4.570
US-Dollar	48.778	11.933	4.433	21.541	-182	-99	86.404
Gesamt	\$ 144.250	\$ 25.268	\$ 4.433	\$ 1.202	\$ -42	\$ 3.552	\$ 178.663

^ 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ 2.810	\$ –	\$ –	\$ -2.073	\$ -10	\$ 277	\$ 1.004
Brasilianischer Real	1.836	–	–	-44	–	33	1.825
Britisches Pfund	6.884	136	–	-8.330	9	359	-942
Kanadischer Dollar	1.674	–	–	69.016	–	191	70.881
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-11.569	–	-1	-11.570
Euro	14.561	5.299	–	-24.074	-74	626	-3.662
Indonesische Rupiah	1.204	–	–	–	–	105	1.309
Japanischer Yen	10.196	–	–	-9.605	67	139	797
Mexikanischer Peso	1.896	–	–	-953	–	44	987
Norwegische Krone	1.628	–	–	-572	–	35	1.091
Polnischer Zloty	1.626	–	–	-1.622	–	31	35
Südafrikanischer Rand	1.761	–	–	-662	–	89	1.188
Südkoreanischer Won	1.716	–	–	-1.748	–	55	23
US-Dollar	29.924	4.980	8.932	-8.442	179	-1.208	34.365
Gesamt	\$ 77.716	\$ 10.415	\$ 8.932	\$ -678	\$ 171	\$ 775	\$ 97.331
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 791	\$ 1.062	\$ –	\$ -1.967	\$ –	\$ 118	\$ 4
Kanadischer Dollar	–	–	–	-5	–	–	-5
Euro	9.496	3.933	–	-8.354	-81	28	5.022
Japanischer Yen	–	–	–	-26	–	31	5
US-Dollar	8626	1.688	1.392	10.372	55	-33	22.100
Gesamt	\$ 18.913	\$ 6.683	\$ 1.392	\$ 20	\$ -26	\$ 144	\$ 27.126
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.239	\$ -14	\$ 130	\$ 2.355
Brasilianischer Real	1.683	–	–	-1.141	-774	90	-142
Britisches Pfund	2.063	1.844	–	277.530	75	215	281.727
Kanadischer Dollar	–	–	–	16.931	–	853	17.784
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-4.303	–	255	-4.048
Euro	–	1.877	–	50.283	-322	757	52.595
Indische Rupie	3.139	–	–	-3.187	–	92	44
Jamaika-Dollar	198	–	–	–	–	6	204
Japanischer Yen	–	–	–	25.967	–	–	25.967
Mexikanischer Peso	1.039	–	–	-1.557	89	729	300
Neuseeland-Dollar	–	–	–	–	–	8	8
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	2	2
Schweizer Franken	–	–	–	4.140	–	–	4.140
Türkische Lira	–	–	–	–	–	2	2
US-Dollar	227.044	137.680	–	-362.564	984	22.941	26.085
Gesamt	\$ 235.166	\$ 141.401	\$ –	\$ 4.338	\$ 38	\$ 26.080	\$ 407.023
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.339	\$ –	\$ –	\$ 1.339
Schweizer Franken	–	–	–	73	–	–	73
US-Dollar	99.709	397.095	15.274	-1.405	-1.088	4.205	513.790
Gesamt	\$ 99.709	\$ 397.095	\$ 15.274	\$ 7	\$ -1.088	\$ 4.205	\$ 515.202
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.136.665	\$ 87.935	\$ 77.894	\$ –	\$ 1.668	\$ -83.775	\$ 1.220.387
Gesamt	\$ 1.136.665	\$ 87.935	\$ 77.894	\$ –	\$ 1.668	\$ -83.775	\$ 1.220.387
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 32	\$ –	\$ 12	\$ 44
Brasilianischer Real	94	–	–	601	-69	5	631
Britisches Pfund	–	–	–	-376	4	52	-320
Kanadischer Dollar	–	–	–	132	–	11	143
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-829	–	–	-829
Euro	–	–	–	-220	–	18	-202
Indische Rupie	233	–	–	–	–	6	239
Japanischer Yen	–	–	–	316	–	6	322
Mexikanischer Peso	–	–	–	538	–	94	632
Norwegische Krone	–	–	–	154	–	–	154
Schweizer Franken	–	–	–	-348	–	–	-348
US-Dollar	13.727	1.669	1.645	-3	42	771	17.851
Gesamt	\$ 14.054	\$ 1.669	\$ 1.645	\$ -3	\$ -23	\$ 975	\$ 18.317

[^] 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 1.586	\$ –	\$ –	\$ -409	\$ –	\$ 17	\$ 1.194
Britisches Pfund	14.309	–	–	-3.071	–	82	11.320
Kanadischer Dollar	–	–	–	1.400	–	–	1.400
Chilenischer Peso	–	–	–	458	–	–	458
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.551	–	–	-1.551
Kolumbianischer Peso	114	–	–	-115	–	9	8
Euro	–	–	–	14.435	–	71	14.506
Japanischer Yen	–	–	–	399	–	–	399
Mexikanischer Peso	3.496	–	–	-796	–	127	2.827
Neuseeland-Dollar	–	–	–	1.194	–	–	1.194
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	332	332
US-Dollar	5.299	34.391	1.367	-11.583	–	-407	29.067
Gesamt	\$ 24.804	\$ 34.391	\$ 1.367	\$ 361	\$ –	\$ 231	\$ 61.154
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 11.483	\$ –	\$ –	\$ -11.735	\$ –	\$ 210	\$ -42
Britisches Pfund	–	–	–	2.777	104	-1	2.880
Kanadischer Dollar	–	–	–	6.674	-234	-289	6.151
Chilenischer Peso	–	–	–	6.670	–	–	6.670
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-17.422	–	–	-17.422
Kolumbianischer Peso	5.244	–	–	-5.380	–	209	73
Ägyptisches Pfund	9.215	–	–	–	–	–	9.215
Euro	–	–	–	29.206	–	–	29.206
Ungarischer Forint	–	–	–	-6.672	–	–	-6.672
Mexikanischer Peso	9.506	–	–	3.739	–	459	13.704
Neuseeland-Dollar	–	–	–	13.213	–	–	13.213
Polnischer Zloty	–	4.089	–	-4.067	–	137	159
Südafrikanischer Rand	5.659	–	–	-2.603	–	4	3.060
Schweizer Franken	–	–	–	-6.675	–	–	-6.675
US-Dollar	53.704	28.018	4.102	-8.202	–	2.890	80.512
Gesamt	\$ 94.811	\$ 32.107	\$ 4.102	\$ -477	\$ -130	\$ 3.619	\$ 134.032
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 321	\$ –	\$ –	\$ 37	\$ –	\$ 4	\$ 362
Kanadischer Dollar	–	–	–	17.902	–	-1	17.901
Euro	2.257	–	–	8.972	–	49	11.278
Schwedische Krone	–	–	–	-3	–	–	-3
Schweizer Franken	–	–	–	-3	–	–	-3
US-Dollar	36.559	239	3.041	-27.136	23	826	13.552
Gesamt	\$ 39.137	\$ 239	\$ 3.041	\$ -231	\$ 23	\$ 878	\$ 43.087
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 8.660	\$ –	\$ –	\$ 2.575	\$ –	\$ 121	\$ 11.356
Brasilianischer Real	6.950	–	–	-6.901	–	129	178
Britisches Pfund	30.255	–	–	-24.257	–	97	6.095
Kanadischer Dollar	5.226	–	–	-237	–	-1	4.988
Chilenischer Peso	–	–	–	5.496	–	–	5.496
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.373	–	–	-1.373
Kolumbianischer Peso	967	–	–	-908	–	70	129
Dänische Krone	–	–	–	-27	–	–	-27
Ägyptisches Pfund	8.372	–	–	–	–	–	8.372
Euro	8.845	–	–	42.619	–	–	51.464
Israelischer Schekel	–	–	–	-44	–	–	-44
Japanischer Yen	–	–	–	21.266	–	–	21.266
Mexikanischer Peso	18.100	–	–	2.540	–	668	21.308
Neuseeland-Dollar	–	–	–	18.345	–	1	18.346
Norwegische Krone	–	–	–	-19	–	–	-19
Polnischer Zloty	–	–	–	-68	–	600	532
Singapur-Dollar	–	–	–	-46	–	1	-45
Südafrikanischer Rand	7.532	–	–	-3.522	–	5	4.015
Schwedische Krone	–	–	–	-20	–	–	-20
US-Dollar	35.980	42.783	5.563	-56.121	–	-717	27.488
Gesamt	\$ 130.887	\$ 42.783	\$ 5.563	\$ -702	\$ –	\$ 974	\$ 179.505

[^] 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.507	\$ –	\$ –	\$ 3.507
Brasilianischer Real	17.633	–	–	-16.237	–	263	1.659
Britisches Pfund	19.030	1.327	–	-1.739	–	338	18.956
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.643	–	–	1.643
Kolumbianischer Peso	2.517	–	–	–	–	171	2.688
Tschechische Krone	–	–	–	470	–	-1	469
Ägyptisches Pfund	24.511	–	–	–	–	–	24.511
Euro	–	–	–	337.321	–	520	337.841
Mexikanischer Peso	54.493	–	–	–	–	1.821	56.314
Singapur-Dollar	–	–	–	44.381	–	49	44.430
Schwedische Krone	–	–	–	2.334	–	–	2.334
US-Dollar	503.865	237.133	30.962	-371.361	474	19.659	420.732
Gesamt	\$ 622.049	\$ 238.460	\$ 30.962	\$ 319	\$ 474	\$ 22.820	\$ 915.084
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]							
Ägyptisches Pfund	\$ 314	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 315
US-Dollar	7.799	2.464	483	–	-80	-84	10.582
Gesamt	\$ 8.113	\$ 2.464	\$ 483	\$ –	\$ -80	\$ -83	\$ 10.897
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]							
US-Dollar	\$ 29.933	\$ 5.932	\$ 742	\$ –	\$ 22	\$ 188	\$ 36.817
Gesamt	\$ 29.933	\$ 5.932	\$ 742	\$ –	\$ 22	\$ 188	\$ 36.817
FTGF ClearBridge US Value Fund							
Kanadischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 17.094	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 17.094
Euro	–	–	32.190	58.586	–	223	90.999
Japanischer Yen	–	–	9.577	–	–	–	9.577
Singapur-Dollar	–	–	–	1.576	–	15	1.591
US-Dollar	–	–	1.081.568	-59.362	–	73.902	1.096.108
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.140.429	\$ 800	\$ –	\$ 74.140	\$ 1.215.369
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -3	\$ -3
US-Dollar	–	–	179.506	–	–	2.257	181.763
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 179.506	\$ –	\$ –	\$ 2.254	\$ 181.760
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 42.969	\$ –	\$ –	\$ 42.969
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	58	58
Euro	–	–	–	100.049	–	-75	99.974
US-Dollar	–	–	1.948.068	-142.394	–	51.306	1.856.980
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.948.068	\$ 624	\$ –	\$ 51.289	\$ 1.999.981
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.160	\$ –	\$ -19	\$ 3.141
Britisches Pfund	–	–	–	176	–	20	196
Chinesischer Renminbi	–	–	–	643	–	–	643
Euro	–	–	–	636	–	-2	634
Singapur-Dollar	–	–	–	1.211	–	–	1.211
Schwedische Krone	–	–	–	25	–	1	26
Schweizer Franken	–	–	–	63	–	–	63
US-Dollar	–	–	175.395	-5.939	–	1.359	170.815
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 175.395	\$ -25	\$ –	\$ 1.359	\$ 176.729
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 723	\$ –	\$ –	\$ 723
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	5	5
Chinesischer Renminbi	–	–	–	53	–	–	53
Euro	–	–	–	617	–	1	618
Singapur-Dollar	–	–	–	321	–	3	324
US-Dollar	–	–	38.854	-1.720	–	1.579	38.713
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 38.854	\$ -6	\$ –	\$ 1.588	\$ 40.436
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 49.493	\$ –	\$ 458	\$ 49.951
Euro	–	–	–	22.654	–	162	22.816
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	15	15
US-Dollar	–	–	912.104	-71.224	–	7.694	848.574
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 912.104	\$ 923	\$ –	\$ 8.329	\$ 921.356

[^] 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 2025 – (Fortsetzung)

	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)							
Währung														
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund														
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	–	\$	3	\$	1.368				
Kanadischer Dollar	–	–	–	732	–	–	–	–	–	732				
Dänische Krone	–	–	–	479	–	–	–	–	–	479				
Euro	–	–	–	2.906	–	–	5	–	–	2.911				
Hongkong-Dollar	–	–	–	690	–	–	–	–	–	690				
Japanischer Yen	–	–	–	1060	–	–	1	–	–	1.061				
Südkoreanischer Won	–	–	–	247	–	–	1	–	–	248				
Schweizer Franken	–	–	–	190	–	–	–	–	–	190				
Taiwan-Dollar	–	–	–	513	–	–	–	–	–	513				
US-Dollar	–	–	–	19.019	–	–	118	–	–	19.137				
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	128	\$	27.329		
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^														
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	609	€	–	€	476	€	15.500		
Brasilianischer Real	–	–	–	13.090	–	-165	–	–	–	–	–	12.925		
Britisches Pfund	–	–	–	53.613	–	-1.282	–	–	–	-4	–	52.327		
Kanadischer Dollar	–	–	–	104.642	–	37.419	–	–	–	–	–	142.061		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	10.931	–	–	–	244	–	11.175		
Euro	–	–	–	224.786	–	-116.975	–	–	–	15.490	–	123.301		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	4.484	–	–	–	-29	–	4.455		
US-Dollar	–	–	–	307.637	–	63.924	–	–	–	866	–	372.427		
Gesamt	€	–	€	–	€	718.183	€	–	€	-1.055	€	17.043	€	734.171
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund														
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	11.025	\$	5.159	\$	–	\$	217	\$	16.401
Brasilianischer Real	–	–	–	10.802	–	–	–	–	–	–	–	–	10.802	
Britisches Pfund	–	–	–	30.614	–	6.142	–	–	–	140	–	36.896		
Kanadischer Dollar	–	–	–	47.257	–	–	–	–	–	110	–	47.367		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	1.153	–	–	–	–	–	1.153		
Euro	–	–	–	76.571	–	6.958	–	–	–	932	–	84.461		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	41.461	–	–	–	95	–	41.556		
US-Dollar	–	–	–	105.343	–	-60.744	–	–	–	3.914	–	48.513		
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	281.612	\$	129	\$	–	\$	5.408	\$	287.149
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^														
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	1.009	\$	13	\$	–	\$	-1	\$	1.021
Kanadischer Dollar	–	–	–	130	–	–	–	–	–	–	–	130		
Euro	–	–	–	1.398	–	13	–	–	–	3	–	1.414		
Indonesische Rupiah	–	–	–	58	–	–	–	–	–	–	–	58		
Japanischer Yen	–	–	–	225	–	–	–	–	–	–	–	225		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	13	–	–	–	–	–	13		
US-Dollar	–	–	–	3.297	–	-39	–	–	–	580	–	3.838		
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	6.117	\$	–	\$	–	\$	582	\$	6.699
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund														
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$	4.786	\$	–	\$	1.269	\$	6.055
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	1.262	–	–	–	–	–	-1	–	1.261
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	127	–	–	–	–	–	361	–	488
Kanadischer Dollar	–	–	–	22.950	–	–	–	–	–	–	–	36	–	22.986
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	1.878	–	–	–	–	–	48	–	1.926
Euro	–	–	–	2.914	–	64.721	–	–	–	–	–	-211	–	67.424
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	5.757	–	–	–	–	–	–	–	5.757
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	21.620	–	–	–	–	–	38	–	21.658
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	105	–	–	–	–	–	–	–	105
US-Dollar	–	–	–	958.744	–	-99.516	–	–	–	–	–	-2.554	–	856.674
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	984.608	\$	740	\$	–	\$	-1.014	\$	984.334
FTGF Royce US Smaller Companies Fund														
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.882	\$	–	\$	–	\$	1	\$	1.883
Euro	–	–	–	–	–	325	–	–	–	–	–	-2	–	323
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	1	–	–	–	–	–	–	–	1
US-Dollar	–	–	–	81.434	–	-324	–	–	–	–	–	-464	–	80.646
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	83.316	\$	2	\$	–	\$	-465	\$	82.853

^ 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 2025 – (Fortsetzung)

	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)		Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)		Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)		Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)		Sonstige Derivate (in Tsd.)		Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)		Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)	
Währung														
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^														
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	209	\$	–	\$	–	\$	3	\$	212
Brasilianischer Real		–		–		46		–		–		1		47
Britisches Pfund		–		–		653		–		–		–		653
Euro		–		–		472		–		–		1		473
Japanischer Yen		–		–		487		–		–		–		487
Polnischer Zloty		–		–		59		–		–		–		59
Südkoreanischer Won		–		–		84		–		–		–		84
Schwedische Krone		–		–		86		–		–		1		87
Schweizer Franken		–		–		89		–		–		–		89
US-Dollar		–		–		2.215		–		–		-84		2.131
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	4.400	\$	–	\$	–	\$	-78	\$	4.322
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^														
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	462	\$	–	\$	–	\$	–	\$	462
Britisches Pfund		–		–		–		1.479		–		1		1.480
Kanadischer Dollar		–		–		629		–		–		–		629
Dänische Krone		–		–		947		–		–		29		976
Euro		–		–		6.058		6.784		–		–		12.842
Schwedische Krone		–		–		960		–		–		–		960
Schweizer Franken		–		–		524		–		–		–		524
US-Dollar		–		–		11.961		-8.153		–		-185		3.623
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	21.541	\$	110	\$	–	\$	-155	\$	21.496
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^														
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	1.234	\$	–	\$	–	\$	7	\$	1.241
Britisches Pfund		–		–		505		–		–		–		505
Chinesischer Renminbi		–		–		1.597		–		–		–		1.597
Hongkong-Dollar		–		–		7.402		–		–		1		7.403
Indische Rupie		–		–		6.131		–		–		-3		6.128
Indonesische Rupiah		–		–		607		–		–		6		613
Mexikanischer Peso		–		–		633		–		–		–		633
Philippinischer Peso		–		–		16		–		–		1		17
Polnischer Zloty		–		–		350		–		–		–		350
Saudi-Rial		–		–		968		–		–		–		968
Südafrikanischer Rand		–		–		596		-9		–		9		596
Südkoreanischer Won		–		–		3.438		–		–		66		3.504
Taiwan-Dollar		–		–		5.723		–		–		–		5.723
US-Dollar		–		–		2.671		9		–		-5		2.675
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	31.871	\$	–	\$	–	\$	82	\$	31.953
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^														
Britisches Pfund	€	–	€	–	€	3.732	€	–	€	–	€	–	€	3.732
Dänische Krone		–		–		6.886		–		–		60		6.946
Euro		–		–		49.043		–		–		520		49.563
Schwedische Krone		–		–		9.589		–		–		–		9.589
Schweizer Franken		–		–		5.253		–		–		-1		5.252
US-Dollar		–		–		7.894		–		–		41		7.935
Gesamt	€	–	€	–	€	82.397	€	–	€	–	€	620	€	83.017
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^														
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	2.109	\$	1.514	\$	–	\$	-206	\$	3.417
Dänische Krone		–		–		720		–		–		1		721
Euro		–		–		1.161		99		–		–		1.260
Indonesische Rupiah		–		–		235		–		–		–		235
Japanischer Yen		–		–		75		–		–		–		75
Schwedische Krone		–		–		320		–		–		–		320
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate		–		–		335		–		–		–		335
US-Dollar		–		–		10.312		-1.589		–		450		9.173
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	15.267	\$	24	\$	–	\$	245	\$	15.536
Franklin Responsible Income 2028 Fund^														
Euro	€	57.960	€	24.206	€	–	€	–	€	–	€	785	€	82.951
Gesamt	€	57.960	€	24.206	€	–	€	–	€	–	€	785	€	82.951
Franklin Responsible Income 2029 Fund^														
Euro	€	24.142	€	14.280	€	–	€	–	€	–	€	724	€	39.146
Gesamt	€	24.142	€	14.280	€	–	€	–	€	–	€	724	€	39.146

[^] 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

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (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	\$ –	\$ 1.458	\$ -5.757	\$ 185.460
Gesamt	\$ 145.427	\$ 41.224	\$ 3.108	\$ –	\$ 1.458	\$ -5.757	\$ 185.460
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Argentinischer Peso	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ 2
Australischer Dollar	–	–	–	9.020	–	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	–	–	1.880	–	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	2541	–	–	–	–	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
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

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.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
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
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

[^] 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.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
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
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

[^] 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 festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
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 festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (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	4534
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. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 29. Februar 2024 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (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)

	Anlagen in festverzinsli- chen		Anlagen in variabel verzins- lichen		Anlagen in unverzinslichen				Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten		Gesamt- Nettoinventar- wert	
Währung	Wertpapieren (in Tsd.)		Wertpapieren (in Tsd.)		Wertpapieren (in Tsd.)		Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)		Sonstige Derivate (in Tsd.)		Nettoinventar- wert (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	\$	–	\$	–	\$	16.718
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^												
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	16.869	€	1.203	€	–	€	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	€	–	€	822.923
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	14.465	\$	5.632	\$	–	\$	193
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		–	3538	50.576
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	326.235	\$	131	\$	–	\$	331.809
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^												
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	693	\$	12	\$	–	\$	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	\$	–	\$	–	\$	5.641
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$	5.403	\$	–	\$	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	\$	–	\$	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)

	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)		Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)		Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)		Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)		Sonstige Derivate (in Tsd.)		Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)		Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)	
Währung														
FTGF Royce US Smaller Companies Fund														
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.622	\$	–	\$	–	\$	–	\$	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^														
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	155	\$	–	\$	–	\$	2	\$	157
Brasilianischer Real		–		–		74		–		–		-2		72
Britisches Pfund		–		–		677		–		–		–		677
Euro		–		–		261		–		–		–		261
Japanischer Yen		–		–		492		–		–		1		493
Polnischer Zloty		–		–		55		–		–		–		55
Südkoreanischer Won		–		–		77		–		–		2		79
Schwedische Krone		–		–		58		–		–		1		59
Schweizer Franken		–		–		73		–		–		–		73
US-Dollar		–		–		2.500		–		–		-40		2460
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	4.422	\$	–	\$	–	\$	-36	\$	4.386
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^														
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	\$	–	\$	–	\$	7.210	\$	21	\$	–	\$	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^														
Brasilianischer Real	\$	–	\$	–	\$	1.795	\$	–	\$	–	\$	7	\$	1802
Britisches Pfund		–		–		797		–		–		–		797
Chinesischer Renminbi		–		–		1.189		–		–		-75		1114
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
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

^ 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)

	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)					
Währung												
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^												
Britisches Pfund	\$	–	\$	821	\$	1.355	\$	–	\$	2.176		
Dänische Krone		–		359		–		–		360		
Euro		–		557		96		–		653		
Indonesische Rupiah		–		197		–		–		196		
Japanischer Yen		–		71		–		–		71		
Schwedische Krone		–		95		–		–		95		
Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate		–		111		–		–		111		
US-Dollar		–		3.913		-1.446		–		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

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 28. Februar 2025 und am 29. Februar 2024 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 Gesamtnettoinventarwert vorgenommen. Des Weiteren wird angenommen, dass auch alle anderen Marktparameter unverändert bleiben.

		Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse* (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		28. Februar 2025		29. Februar 2024	
Fonds	Währung	Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Australischer Dollar	2.397	-2.169	3.398	-3.074
	Südafrikanischer Rand	1.329	-1.202	/	/
	Schweizer Franken	3.133	-2.835	3.127	-2.829
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	248	-224	284	-257
	Chinesischer Renminbi	3.547	-3.209	3.766	-3.407
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Indische Rupie	1.270	-1.149	1.540	-1.393
	Indonesische Rupiah	/	/	1.763	-1.595
	Malaysischer Ringgit	1.523	-1.378	1.537	-1.391
	Singapur-Dollar	1.278	-1.156	1.755	-1.588
	Südkoreanischer Won	1.297	-1.173	1.880	-1.701
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Britisches Pfund	3.746	-3.389	14.522	-13.139
	Euro	/	/	3.213	-2.907
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Kanadischer Dollar	3.731	-3.375	3.943	-3.568
	Chinesischer Renminbi	-609	551	-682	617
	Euro	/	/	805	-729
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Euro	264	-239	244	-221
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Euro	/	/	19.863	-17.972
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Britisches Pfund	14.828	-13.416	14.033	-12.696
	Euro	2.768	-2.505	3.002	-2.716
	Britisches Pfund	596	-539	850	-769
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Euro	763	-691	1.672	-1.513
	Australischer Dollar	/	/	1.426	-1.291
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Britisches Pfund	/	/	801	-725
	Chinesischer Renminbi	-917	830	/	/
	Euro	1.537	-1.391	/	/
	Mexikanischer Peso	721	-653	/	/
	Neuseeland-Dollar	/	/	-1.133	1025
	Schweizer Franken	/	/	-1.172	1.061
	Kanadischer Dollar	942	-852	589	-533
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Euro	594	-537	574	-519
	Australischer Dollar	/	/	1.295	-1.172
	Euro	2.709	-2.451	/	/
	Japanischer Yen	1.119	-1.013	1.654	-1.496
	Mexikanischer Peso	1.121	-1.015	/	/
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Neuseeland-Dollar	966	-874	/	/
	Euro	17.781	-16.088	20.856	-18.870
	Australischer Dollar	/	/	3.813	-3.450
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Brasilianischer Real	/	/	456	-413
	Japanischer Yen	/	/	886	-801
	Mexikanischer Peso	/	/	736	-666
	Schweizer Franken	/	/	-954	863
	Euro	153	-139	/	/
FTGF ClearBridge US Value Fund	Euro	/	/	7.035	-6.365
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Kanadischer Dollar	7.477	-6.765	/	/
	US-Dollar	19.601	-17.735	22.231	-20.114

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse*
(Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)

Fonds	Währung	28. Februar 2025		29. Februar 2024	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Britisches Pfund	1.942	-1.757	2.055	-1.859
	Kanadischer Dollar	2.493	-2.256	/	/
	Euro	4.445	-4.022	5.932	-5.367
	Singapur-Dollar	2.187	-1.979	2.632	-2.381
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	Britisches Pfund	54	-49	/	/
	Euro	74	-67	/	/
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Britisches Pfund	34	-31	36	-32
	Euro	25	-23	/	/
	Japanischer Yen	26	-23	26	-23
	Euro	676	-612	6.179	-5.591
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^	Australischer Dollar	/	/	389	-352
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^	Hongkong-Dollar	/	/	310	-281
	Indische Rupie	/	/	120	-108
	Singapur-Dollar	/	/	119	-107
	Hongkong-Dollar	390	-353	278	-251
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^	Indische Rupie	323	-292	338	-306
	Südkoreanischer Won	184	-167	274	-248
	Taiwan-Dollar	301	-273	212	-192
	Schwedische Krone	505	-457	1.333	-1.206
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^	Britisches Pfund	180	-163	115	-104
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	Euro	/	/	34	-31

Eine Analyse wird angegeben, sofern der Fonds ein erhebliches Fremdwährungsentagement 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 sind in Erläuterung 11 angegeben. Diese Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Sensitivitätsanalyse für das Fremdwährungsrisiko für den FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde), 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^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde) und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^ (für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024, da der Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 eingestellt wurde) wurde in die Berechnung des Marktrisikos unter Anwendung des VaR-Ansatzes 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 wurden die gesamten Barmittel der Fonds bei der Verwahrstelle oder sonstigen Brokern geführt 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 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 wie folgt dar:

Zum 28. Februar 2025

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,21 %	0,14
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	4,39 %	20,43
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	6,76 %	1,93
Indische Rupie	7,22 %	5,61
US-Dollar	4,61 %	18,33
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,79 %	1,84
Euro	4,41 %	5,60
Indische Rupie	6,62 %	3,53
Indonesische Rupiah	6,93 %	2,21
Mexikanischer Peso	9,22 %	13,23
Polnischer Zloty	2,25 %	7,16
Britisches Pfund	5,31 %	5,53
Südafrikanischer Rand	9,92 %	16,01
US-Dollar	4,84 %	8,78
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,53 %	5,51
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,23 %	4,09
Britisches Pfund	5,51 %	2,75
US-Dollar	6,91 %	6,49
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	6,77 %	16,75
Indische Rupie	7,10 %	10,76
Indonesische Rupiah	7,01 %	23,90
Malaysischer Ringgit	3,99 %	6,50
Philippinischer Peso	6,33 %	10,88
Singapur-Dollar	2,77 %	27,23
Südkoreanischer Won	2,22 %	11,33
Thailändischer Baht	2,71 %	10,44
US-Dollar	4,53 %	4,99

^ 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	2,11 %	4,24
Britisches Pfund	3,15 %	3,33
US-Dollar	3,32 %	4,40
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Australischer Dollar	3,90 %	9,23
Brasilianischer Real	12,33 %	5,84
Kanadischer Dollar	3,48 %	16,80
Euro	1,49 %	9,37
Indonesische Rupiah	7,49 %	14,13
Japanischer Yen	0,75 %	8,28
Mexikanischer Peso	9,47 %	17,72
Norwegische Krone	3,21 %	8,50
Polnischer Zloty	2,25 %	7,16
Britisches Pfund	4,79 %	9,22
Südafrikanischer Rand	9,92 %	16,01
Südkoreanischer Won	1,89 %	1,28
US-Dollar	4,53 %	16,36
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	3,08 %	7,14
Britisches Pfund	4,51 %	5,76
US-Dollar	5,28 %	12,75
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,36 %	5,04
Indische Rupie	7,20 %	5,61
Jamaika-Dollar	9,25 %	5,68
Mexikanischer Peso	7,02 %	4,48
Britisches Pfund	5,65 %	2,36
US-Dollar	6,81 %	8,46
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	6,12 %	19,36
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	4,99 %	24,13
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,52 %	6,58
Indische Rupie	7,22 %	5,61
US-Dollar	4,40 %	15,62
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	4,24 %	5,07
Kolumbianischer Peso	11,55 %	17,25
Mexikanischer Peso	9,70 %	24,28
Britisches Pfund	4,19 %	19,85
US-Dollar	4,46 %	16,55
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	13,02 %	8,55
Kolumbianischer Peso	11,77 %	24,81
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,21
Mexikanischer Peso	9,83 %	28,44
Südafrikanischer Rand	11,08 %	23,01
US-Dollar	6,08 %	22,59
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	8,42 %	4,35
Britisches Pfund	4,49 %	3,26
US-Dollar	7,15 %	4,95
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	4,23 %	1,14
Brasilianischer Real	13,01 %	8,56
Kanadischer Dollar	0,00 %	0,19
Kolumbianischer Peso	10,12 %	12,20
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,21
Euro	0,00 %	0,13
Mexikanischer Peso	9,69 %	24,08
Britisches Pfund	3,75 %	27,83
Südafrikanischer Rand	11,08 %	23,01
US-Dollar	5,80 %	26,93
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Brasilianischer Real	10,79 %	1,84
Kolumbianischer Peso	8,37 %	6,07
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,18
Mexikanischer Peso	8,80 %	11,17
Britisches Pfund	4,68 %	28,67
US-Dollar	7,09 %	6,35
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,03
US-Dollar	7,81 %	5,51

[^] 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 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
US-Dollar	4,88 %	20,35
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,50 %	3,10
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]		
Euro	3,65 %	4,11

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
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

[^] 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 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
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

[^] 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 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
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

(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.

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.

[^] 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)

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte zum 28. Februar 2025 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	499	1.803	62	65
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-175	-971	-532	–
	–	324	832	-470	65
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 1.267.807	\$ 96.203	\$ 238.446	\$ 216.589	\$ 86.262
Anleihen und Schuldtitel	–	-1.266	–	–	–
Geldmarktinstrumente	437.443	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	4.044	–	3.211	957
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	259	868	613	36
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-190	-1.002	-1.070	-36
	1.705.250	99.050	238.312	219.343	87.219
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 271	\$ 916
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	271	916
Anlagen insgesamt	\$ 1.705.250	\$ 99.374	\$ 239.144	\$ 219.144	\$ 88.200

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	188	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	57	21	416	434	107
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-218	-263	-14
	245	21	198	171	93
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 40.329	\$ 185.259	\$ 169.518	\$ 88.227	\$ 25.596
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	-96	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	5.439	4.433	8.932	1.392
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	74	89	1.358	276	41
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-65	-176	-396	-954	-140
	40.338	190.611	174.913	96.385	26.889
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 108	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	108	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 40.691	\$ 190.632	\$ 175.111	\$ 96.556	\$ 26.982

^ 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 Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	9.744	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.027	–	1.668	177	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-428	-1.088	–	-224	–
	599	8.656	1.668	-47	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 374.234	\$ 481.119	\$ 1.245.632	\$ 15.700	\$ 59.195
Anleihen und Schuldtitel	–	–	-21.032	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	5.530	77.894	1.645	1.367
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	5.181	7	–	172	515
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-1.404	–	–	-151	-154
	378.011	486.656	1.302.494	17.366	60.923
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 2.333	\$ 15.685	\$ –	\$ 23	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2.333	15.685	–	23	–
Anlagen insgesamt	\$ 380.943	\$ 510.997	\$ 1.304.162	\$ 17.342	\$ 60.923

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	104	23	–	713	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-234	–	–	–	–
	-130	23	–	713	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 126.918	\$ 39.376	\$ 173.670	\$ 860.509	\$ 10.577
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.102	2.994	5.563	30.962	470
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.531	1	1.206	3.659	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-2.008	-232	-1.908	-3.579	-80
	130.543	42.139	178.531	891.551	10.967
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	47	–	–	13
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	47	–	–	13
Anlagen insgesamt	\$ 130.413	\$ 42.209	\$ 178.531	\$ 892.264	\$ 10.980

^ 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 Multi- Sector Impact Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Value Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.140.429	179.506	1.948.068
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	22	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	22	1.140.429	179.506	1.948.068
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 35.865	\$ –	\$ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	742	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	802	–	1.978
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-2	–	-1.354
	–	36.607	800	–	624
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	15	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	15	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 15	\$ 36.629	\$ 1.141.229	\$ 179.506	\$ 1.948.692

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	175.395	38.854	912.104	27.201	718.183
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	175.395	38.854	912.104	27.201	718.183
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	21	4	926	–	158
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-46	-10	-3	–	-1.213
	-25	-6	923	–	-1.055
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 175.370	\$ 38.848	\$ 913.027	\$ 27.201	€ 717.128

^ 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 Infrastructure Income Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	281.612	6.117	951.479	81.505	4.278
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	281.612	6.117	951.479	81.505	4.278
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	33.129	1.811	122
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	198	–	894	2	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-69	–	-154	–	–
	129	–	33.869	1.813	122
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 281.741	\$ 6.117	\$ 985.348	\$ 83.318	\$ 4.400

	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	21.343	31.866
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	21.343	31.866
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	198	5
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	112	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-2	–
	–	–	–	308	5
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	€ –	\$ –	\$ –	\$ 21.651	\$ 31.871

^ 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 Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Improving Society Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2029 Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1				
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	€ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	82.397	15.267	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	82.397	15.267	–	–
Stufe 2				
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	€ 82.166	€ 38.422
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	24	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	24	82.166	38.422
Stufe 3				
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	€ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–
	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	€ 82.397	\$ 15.291	€ 82.166	€ 38.422

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 Bond 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	1.779	9	43
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-145	-747	-224	-139
	–	113	1.032	-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

^ 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 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. Risikoexposition 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

Als „–“ angegebene Beträge belaufen sich entweder auf 0 \$/0 €/0 £ oder weniger als 1.000 \$/1.000 €/1.000 £.

Wertpapiere, die von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Anlageverwalter zum 28. Februar 2025 zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind im Anlageportfolio 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. Bei der Matrix-Bewertung wird der aktuelle Marktwert eines auf US-Dollar lautenden Wertpapiers geschätzt, indem die letzte von einem Broker/Händler erhaltene Notierung verwendet und der Preis um die Veränderung der Rendite der US-Staatsanleihe mit der ähnlichsten Duration wie das zu bewertende Wertpapier angepasst wird.

Die folgenden Tabellen enthalten den Wert der Wertpapiere der einzelnen Fonds, deren Preise von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden und die zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden:

	Single-Broker-Preis (in Tsd.)	Vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet (in Tsd.)
Zum 28. Februar 2025		
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	271 \$	– \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	606 \$	310 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	108 \$	– \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1.730 \$	603 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	– \$	16.263 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	23 \$	– \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	– \$	47 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	– \$	13 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	– \$	15 \$
	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 \$

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 28. Februar 2025 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 28. Februar 2025 wurde die Preisanpassungsmethode von ICE angewendet auf den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge US 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 Leaders 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 Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] (29. Februar 2024: 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, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers

[^] 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)

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[^]).

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:

- (i) 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.
- (ii) 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.

Der Wert der als Sicherheiten im Zusammenhang mit dem Derivatehandel erhaltenen Wertpapiere, die von den folgenden Fonds gehalten werden, lautete zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024 wie folgt:

Fonds	Broker	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
		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	47 \$	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 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	JP Morgan	– \$	1.581 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Goldman Sachs	– \$	58 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Goldman Sachs	272 \$	– \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Morgan Stanley	18 \$	– \$

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. Die jeweiligen Anlageverwalter und/oder 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- aufweist (29. Februar 2024: 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.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

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.

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.

Die folgende Tabelle zeigt den Marktwert der Wertpapiere, die im Zusammenhang mit dem Derivatehandel als Sicherheiten bei Brokern hinterlegt wurden, zum 28. Februar 2025 und 29. Februar 2024:

Fonds	Broker	Zum 28. Februar 2025	Zum 29. Februar 2024
		Marktwert der Sicherheiten in Tsd.	Marktwert der Sicherheiten in Tsd.
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	14 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	37 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	– \$	69.547 \$

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

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-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	100,00 %	100,00 %	AAA	60,00 %	59,99 %	AAA	52,01 %	47,06 %	AAA	–	23,98 %
			AA	8,04 %	7,18 %	AA	7,96 %	5,02 %	AA	–	23,49 %
			A	15,03 %	17,05 %	A	12,85 %	17,71 %	A	–	22,24 %
			BBB	16,61 %	15,50 %	BBB	18,38 %	21,07 %	BBB	–	24,67 %
			BB	0,32 %	0,03 %	BB	5,40 %	5,26 %	BB	–	4,92 %
			B	–	0,25 %	B	1,39 %	1,42 %	B	–	0,70 %
						CCC & niedriger	2,01 %	2,46 %			
	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-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	31,83 %	28,44 %	A	–	0,38 %	BBB	7,71 %	7,57 %	AAA	5,06 %	7,14 %
AA	1,38 %	1,43 %	BBB	7,09 %	6,74 %	BB	42,23 %	41,54 %	AA	17,14 %	19,31 %
A	7,60 %	6,99 %	BB	34,49 %	35,66 %	B	31,56 %	35,83 %	A	50,67 %	41,94 %
BBB	31,96 %	28,50 %	B	38,40 %	36,42 %	CCC & niedriger	18,50 %	15,06 %	BBB	27,13 %	29,77 %
									BB	–	1,84 %
BB	17,31 %	21,21 %	CCC & niedriger	19,94 %	20,80 %						
B	7,38 %	10,34 %	Kein Rating	0,08 %	–						
CCC & niedriger	2,54 %	2,95 %									
Kein Rating	–	0,14 %									
	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-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	2,03 %	6,19 %	AAA	32,73 %	46,41 %	AAA	4,96 %	0,87 %	AAA	–	16,88 %
AA	24,39 %	30,02 %	AA	14,05 %	12,16 %	AA	6,90 %	6,58 %	AA	–	1,97 %
A	73,58 %	63,79 %	A	31,97 %	20,11 %	A	33,25 %	27,18 %	A	–	7,01 %
			BBB	14,96 %	15,98 %	BBB	46,66 %	55,81 %	BBB	–	49,23 %
			BB	5,65 %	4,68 %	BB	7,39 %	9,08 %	BB	–	20,36 %
			B	–	0,56 %	B	0,84 %	0,21 %	B	–	3,81 %
			CCC & niedriger	0,64 %	0,10 %	CCC & niedriger	–	0,27 %	CCC & niedriger	–	0,63 %
									Kein Rating	–	0,11 %
	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 [^]			FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]			Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]		
Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	7,03 %	4,87 %	AAA	10,54 %	1,82 %	AAA	98,63 %	98,23 %	AAA	51,54 %	77,49 %
AA	1,23 %	0,90 %	AA	0,61 %	0,93 %	AA	0,25 %	0,23 %	AA	3,53 %	2,38 %
A	4,09 %	6,08 %	A	7,65 %	3,96 %	A	0,83 %	0,88 %	A	13,58 %	3,53 %
BBB	26,10 %	22,76 %	BBB	17,90 %	17,50 %	BBB	0,20 %	0,35 %	BBB	18,30 %	11,69 %
BB	32,83 %	34,11 %	BB	15,66 %	14,51 %	BB	0,09 %	0,21 %	BB	11,78 %	0,16 %
B	18,63 %	20,68 %	B	15,89 %	14,06 %	B	–	0,10 %	B	0,88 %	0,77 %
CCC & niedriger	10,09 %	10,60 %	CCC & niedriger	31,75 %	47,22 %				CCC & niedriger	0,39 %	–
									Kein Rating	–	3,98 %
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

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		
Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	2,70 %	27,10 %	AAA	–	2,73 %	AA	1,11 %	–	AAA	13,08 %	14,47 %
AA	90,99 %	46,86 %	AA	42,29 %	69,71 %	A	0,35 %	1,74 %	AA	59,14 %	59,25 %
A	–	3,24 %	A	7,90 %	2,04 %	BBB	6,52 %	9,61 %	A	2,07 %	–
BBB	6,31 %	14,08 %	BBB	21,64 %	16,90 %	BB	37,58 %	34,57 %	BBB	11,33 %	17,00 %
BB	–	8,72 %	BB	17,51 %	7,56 %	B	49,89 %	46,72 %	BB	8,39 %	8,31 %
			B	10,66 %	1,06 %	CCC & niedriger	4,55 %	4,09 %	B	5,99 %	0,97 %
						Kein Rating	–	3,27 %			
	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. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund			FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]			FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]			FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		
Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AAA	–	10,52 %	AAA	–	6,16 %	AAA	–	40,85 %	AAA	–	2,81 %
AA	3,35 %	8,71 %	A	3,50 %	–	AA	–	2,03 %	AA	–	26,36 %
A	1,13 %	5,07 %	BBB	16,95 %	11,31 %	BBB	–	32,37 %	A	–	11,92 %
BBB	29,45 %	29,86 %	BB	24,26 %	25,04 %	BB	–	21,39 %	BBB	–	33,73 %
BB	33,50 %	24,44 %	B	44,86 %	51,70 %	B	–	3,36 %	BB	–	17,72 %
B	23,74 %	15,91 %	CCC & niedriger	10,43 %	5,79 %				B	–	6,95 %
CCC & niedriger	8,83 %	5,08 %							CCC & niedriger	–	0,51 %
Kein Rating	–	0,41 %									
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		–	100,00 %		–	100,00 %

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]			Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]			Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]		
Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24	Rating	Feb-25	Feb-24
AA	90,88 %	94,05 %	AA	2,67 %	–	A	22,36 %	–
A	1,91 %	2,07 %	A	36,28 %	–	BBB	54,14 %	–
BBB	6,67 %	3,88 %	BBB	52,06 %	–	BB	18,57 %	–
BB	0,54 %	–	BB	7,44 %	–	B	4,93 %	–
			B	1,55 %	–			–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	–		100,00 %	–

[^] 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 Anteilseignern 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:

- (i) 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;
- (ii) während dessen eine Notlage besteht, infolge derer ein Fonds Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens eines Fonds darstellen, praktisch nicht veräußern kann;
- (iii) während dessen die Preise von Anlagen eines Fonds aus irgendeinem Grund vom Fonds nicht angemessen, unverzüglich oder exakt ermittelt werden können;
- (iv) 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
- (v) 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:

- (a) Ein Fonds darf im Rahmen von Parallelkrediten („Back-to-back“) Fremdwährungen kaufen.
- (b) Ein Fonds darf Geld aufnehmen:
 - (i) bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern eine solche Kreditaufnahme vorübergehend erfolgt, und
 - (ii) 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.

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 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 116	\$ 1.402	\$ –	\$ 1.193	€ –	€ 60
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	324	1.640	692	5.946	–	7
Optionen	–	–	77	10	190	65	–	–
Swapkontrakte	–	–	190	1	706	1.640	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	84	12	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	3	–	222	–	212
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	24.733	9.918	6.253	8.473	51.223	24.808	–	525
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	3.908	3.318	107	166	97	158	–	2
Fällige Managementgebühr	785	513	58	95	148	385	–	3
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	41	30	13	18	24	57	3	8
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	5	9	8	20	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	28	49	357	1.503	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	1.680.756	1.114.418	97.902	185.460	248.773	815.255	–	49.829
1–3 Monate								
Optionen	–	–	30	6	74	25	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	212	1.396	–	15
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	1.266	740	–	5.842	–	–
Optionen	–	–	48	54	73	125	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	20	72	634	330	–	12
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	236	200	117	91	346	353	51	54
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 1.710.459	\$ 1.128.397	\$ 106.554	\$ 198.289	\$ 303.641	\$ 859.335	€ 54	€ 50.727

Verbindlichkeiten (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 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ 235	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	99	8	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	52	15	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	1.214	736	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	59	90	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	30	33	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	9	10	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	38	103	1	1	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	40.789	48.519	–	–	–	–	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	13	9	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	92	70	14	14	17	17	8	12
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 42.395	\$ 49.829	\$ 15	\$ 15	\$ 17	\$ 17	\$ 8	\$ 12

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
\$	–	\$	–	\$	296	\$	–	\$	–
–	–	73	39	93	237	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	20	219	–	–	–	–
–	–	968	1.357	5	1	–	–	–	–
–	–	220	92	–	–	–	–	–	–
–	–	829	541	1.762	2.660	–	–	–	–
–	–	68	86	149	163	–	–	–	–
–	–	107	94	59	57	–	–	–	–
–	2	22	22	12	13	–	–	–	–
–	–	7	6	3	5	–	–	–	–
661	662	13	102	971	35	11	11	–	–
–	–	241.323	240.940	86.953	96.878	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	11	–	–	–	–	–
–	–	102	219	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	312	47	–	–	–	–	–	–
10	11	151	104	80	48	13	12	–	18
\$	671	\$	675	\$	244.195	\$	24	\$	23
			\$ 243.649		\$ 100.316				\$ 18

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 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
\$	49	\$	4	\$	–	\$	129	€	–
1	1	45	5	276	123	88	23	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	240	498	–	–	119	188	–	–
176	182	12	106	777	321	1	1	–	–
–	82	–	76	140	179	12	14	–	–
–	219	–	364	9.619	14.941	668	–	–	–
12	15	1	2	–	–	–	–	–	–
94	151	65	142	9	14	–	1	–	–
19	26	18	36	12	15	8	8	–	–
12	13	7	12	–	–	–	–	–	–
280	523	1.345	590	2	25	2	–	–	–
192.959	250.628	178.663	478.538	97.331	129.420	27.126	30.997	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	144	71	177	50	20	–	–	–
–	–	–	–	96	412	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	218	6	123	51	2	7	–	–
170	159	133	82	112	131	66	57	–	12
\$	193.772	\$	180.895	\$	108.674	\$	28.241	–	€ 12
	\$ 252.235		\$ 480.530		\$ 145.690		\$ 31.325		

^ 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 [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ 4	\$ –	\$ 1.022	\$ –	\$ 533	\$ –	\$ 3.121
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	56.547	241	119	–	–	1.668	72
Optionen	–	5.750	–	8	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	18.195	774	286	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	1.589	250	158	–	6	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	10.696	336	84	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	97.494	4.039	3.733	–	–	171.974	250.542
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	1.269	38	27	15	43	14	15
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	3	80	33	29	40	39	87	77
Fällige Informationsstellengebühren	–	104	–	–	1	1	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.653	3.476	12	4	–	98	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	1.204.969	407.023	372.681	515.202	526.156	1.220.387	1.149.708
1–3 Monate								
Optionen	–	1549	–	9	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	4.869	380	245	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	21.032	6.335
Optionen	–	587	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	8.966	92	169	1.088	306	–	247
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.400	916	186	170	319	284	258	197
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 4.056	\$ 1.417.060	\$ 413.404	\$ 378.744	\$ 516.665	\$ 527.466	\$ 1.415.420	\$ 1.410.314

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 232	\$ 9	\$ 4	\$ –	\$ 617	\$ 1	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	290	270	–	–	270	320	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	1.132	3.050	217	55	1.367	3.062	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	51	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	2.526	–	287	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	43	8	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	96	101	18	1	93	105	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	15	16	8	8	19	22	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	1	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2.176	–	60	2	16	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	134.032	146.269	43.087	31.164	179.505	207.376	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	876	877	15	16	520	785	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	21	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	234	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	228	228	49	41	136	128	–	2.172
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 137.136	\$ 155.574	\$ 43.441	\$ 31.640	\$ 182.550	\$ 211.815	–	\$ 2.172

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		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	
zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
£	£	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
–	–	–	–	–	119	–	–	1	79
–	–	–	–	–	105	–	–	–	–
–	–	–	–	33	6	–	–	–	–
–	–	–	–	112	4	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	85	1.847
–	–	–	–	6	5	–	–	–	–
–	–	–	–	126	137	–	–	–	139
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	43	72
–	3	3	6	17	17	2	11	11	18
–	–	–	–	–	–	–	–	5	10
–	–	–	28	–	–	–	–	3.487	179
–	–	–	–	18.317	18.396	–	–	61.154	145.085
–	–	–	–	14	–	–	–	–	–
–	–	–	–	39	62	–	–	69	499
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	20	12	–	–	–	–
–	–	–	–	151	34	–	–	–	–
35	43	44	89	44	47	14	30	173	343
£ 35	£ 46	\$ 47	\$ 123	\$ 18.879	\$ 18.944	\$ 16	\$ 41	\$ 65.028	\$ 148.271

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^		FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund^		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^	
zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$	\$
3	3.226	132	152	–	–	–	–	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	288
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
239	2.085	80	–	–	–	–	–	–	–
2.653	4.746	–	–	–	–	–	–	–	1.163
–	274	–	–	–	–	–	–	–	167
–	4.968	–	663	–	–	–	–	–	–
128	147	–	–	–	–	–	–	–	–
533	681	5	3	–	–	–	–	–	–
70	82	8	13	–	2	–	–	3	11
57	74	–	–	–	–	–	–	–	–
2.263	4.823	–	5.311	–	–	14	15	–	–
915.084	1.151.380	10.897	16.403	–	–	–	–	–	71.037
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
687	–	–	–	–	–	–	–	–	300
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
245	349	87	80	–	13	–	–	92	171
\$ 921.962	\$ 1.172.835	\$ 11.209	\$ 22.625	–	\$ 15	\$ 14	\$ 15	\$ 95	\$ 73.138

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Value Fund	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ 9	\$ –	\$ 218	\$ –	\$ –	\$ 5.207	\$ 614
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	56	–	–	–	–	2	6
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	4	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	209	–	–	–	–	–	3.823
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	3	–	1	–	791	715
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	5	20	12	4	–	3	100	90
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	94	57
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	17	–	–	–	–	–	9.226	4.096
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	15.829	36.817	31.699	–	–	1.215.369	1.157.626
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	1	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	44	57	25	21	4	19	164	94
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 66	\$ 16.185	\$ 36.857	\$ 31.942	\$ 5	\$ 22	\$1.230.953	\$1.167.121

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund		FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 5	\$ 5.786	\$ –	\$ –	€ 1	€ 1	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	3	16	–	–	1.195	891	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	10.962	–	52	–	450	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	399	583	13	3	598	655	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	85	105	8	8	57	69	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	47	115	–	–	81	76	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	2.729	6.183	–	50	1.257	3.388	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	921.356	1.365.510	27.329	16.718	734.171	822.923	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	18	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	257	159	47	41	172	104	–	24
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 924.881	\$1.389.419	\$ 27.397	\$ 16.872	€ 737.550	€ 828.557	–	\$ 24

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

Legg Mason ClearBridge Growth 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	
zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
\$ –	\$ –	\$ 398	\$ 6	\$ 3	\$ 2	\$ 143	\$ –	\$ –	\$ 74
–	–	–	–	2.000	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	71	304	46	22	10	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	18.684	–	28	–	3
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	185	185	1.319	1.176	183	196	35	20
–	–	23	26	166	189	36	40	9	10
–	–	23	28	162	154	27	36	3	–
17	17	261	562	2.998	2.792	518	208	36	34
–	–	181.760	211.456	1.999.981	1.872.600	176.729	207.390	40.436	35.936
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1.283	8	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	112	86	289	179	214	174	67	55
\$ 17	\$ 17	\$ 182.762	\$ 212.349	\$ 2.008.272	\$ 1.896.088	\$ 177.896	\$ 208.094	\$ 40.596	\$ 36.135

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 [^]	
zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
\$ 2	\$ –	\$ 3	\$ –	\$ 28	\$ 4	\$ 309	\$ –	\$ 11	\$ 8
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
69	124	–	–	117	169	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	5.843	–	3	408	1.393	–	343	47	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
253	296	–	–	928	595	97	97	–	–
33	28	28	10	85	74	14	15	6	6
31	51	–	–	166	111	13	12	–	–
2.150	989	–	–	3.853	3.599	151	25	–	–
287.149	331.809	6.699	5.641	984.334	694.890	82.853	95.935	4.322	4.386
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	37	1	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
94	64	21	15	192	161	78	61	44	40
\$ 289.781	\$ 339.204	\$ 6.751	\$ 5.669	\$ 990.148	\$ 700.997	\$ 83.515	\$ 96.488	\$ 4.430	\$ 4.440

[^] 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 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 [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
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	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	–	–	–	2	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.193	1.175	2.213	2.213	59	59
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	23	23	389	253	26	49	2	2
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 23	\$ 23	€ 1.582	€ 1.428	\$ 2.239	\$ 2.264	\$ 61	\$ 61

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]		FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 180
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	2	22
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	–	–	92	63
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	–	–	–	–	22	64
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	–	–	–	–	10	16
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	1	7
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	51	51	38	38	213	89
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	21.496	124.021
1–3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	83	–	–	23	23	67	51
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	– € 83	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61	\$ 61	\$ 21.903	\$ 124.513

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	
	zum 28. Februar 2025	zum 29. Februar 2024
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	1.329	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–
Fällige Managementgebühr	14	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	7	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	39.146	–
1–3 Monate		
Optionen	–	–
Swaptions	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–
Über 3 Monate		
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–
Optionen	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	25	–
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	€ 40.521	–

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 Dividenden erträge 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[^]

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] held Nil (2024: 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 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 29. Februar 2024 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	– \$	– \$
Rücknahme von Anteilen	-4.023	–
Realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	523	–
Erhaltene Ausschüttungen	–	–
Kosten	–	3.500
Beizulegender Zeitwert	–	3.994
Nicht realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	– \$	494 \$

14. Bedeutende Ereignisse

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 nahm der Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 1. April 2024 hat der Company Secretary gewechselt: An die Stelle von Bradwell Limited ist OGS Corporate Governance Limited getreten.

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 vom 31. Mai 2024 wurde der FTGF ClearBridge Value Fund in FTGF ClearBridge US Value Fund umbenannt.

Mit Wirkung vom 17. Juli 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 26. Juli 2024 stellte der FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^] den Handel ein.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Signifikante Ereignisse – (Fortsetzung)

Mit Wirkung vom 29. Juli 2024 stellte der FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 30. August 2024 wurde Jaspal Sagger als Verwaltungsratsmitglied in den Verwaltungsrat von FTIS bestellt.

Mit Wirkung vom 29. Oktober 2024 stellte der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 31. Oktober 2024 wurde der FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^] in FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^] umbenannt.

Infolge der kürzlich erfolgten Übernahme von Putnam Investments durch Franklin Resources, Inc („Franklin Templeton“) wurden im Namen der Gesellschaft neue Teilfonds mit den Bezeichnungen FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^], FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^] und FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^] (die „neuen Fonds“) aufgelegt, um den Putnam Ultra Short Duration Income Fund, Putnam Global High Yield Bond Fund und Putnam U.S. Large Cap Growth Fund (die „eingebrachten Fonds“) in die neuen Fonds aufzunehmen (die „Zusammenführung“). Am 25. Oktober 2024 wurde von der Gesellschaft ein aktualisierter Hauptprospekt mit den Nachträgen für die neuen Fonds herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Am 31. Oktober 2024 wurde von der Gesellschaft eine neue Fassung des Prospekts herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Der Hauptzweck des aktualisierten Prospekts bestand darin, die Änderung des Namens des ClearBridge Global Growth Fund in ClearBridge Global Growth Leaders Fund zu erleichtern und einige zusätzliche Änderungen oder Klarstellungen in Bezug auf die Anlagepolitik bestimmter Fonds, Benchmarks oder Änderungen der Performanceziele, ESG-Angaben, verbindliche Elemente und Ausschlüsse vorzunehmen, wie in der Mitteilung an die Anteilhaber vom 17. September 2024 dargelegt.

Am 19. November 2024 wurde die Genehmigung des Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

Mit Wirkung vom 19. Dezember 2024 stellte der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel ein.

Am 21. Januar 2025 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrag für den FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^], ein ergänzender Prospekt und ein Sonderprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Am 14. Februar 2025 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrag für den FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], ein ergänzender Prospekt und ein Sonderprospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Am 27. Februar 2025 wurde von der Gesellschaft ein aktualisierter Nachtrag für den FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^] herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2025 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

Mit Wirkung vom 14. März 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^] den Handel auf.

Am 19. März 2025 wurde von der Gesellschaft ein aktualisierter Nachtrag für den FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^] herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 24. März 2025 nahm der FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahmen der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^], FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^] und FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^], die infolge der Zusammenlegung entstanden sind, den Handel auf.

Am 23. April 2025 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrag für den FTGF Putnam Balanced Fund[^], ein Sonderprospekt und für die bestehenden Fonds der Nachtrag der Gesellschaft für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 28. April 2025 wurden von der Gesellschaft ein ergänzender Prospekt für Franklin Templeton Global Funds plc und ein Nachtrag für den FTGF Putnam US Research Fund herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Zum Datum des ergänzenden Prospekts wurde der FTGF ClearBridge US Appreciation Fund in FTGF Putnam US Research Fund umbenannt, und der Anlageverwalter wechselte (vormals ClearBridge Investments, LLC, jetzt The Putnam Advisory Company, LLC). Mit Wirkung vom selben Datum wurde der FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^] in FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^] umbenannt.

Am 8. Mai 2025 wurden die Genehmigungen des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] und Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

Am 14. Mai 2025 wurde von der Gesellschaft ein Nachtrag für den FTGF Putnam Global Healthcare Fund[^] herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Am 21. Mai 2025 wurden ein aktualisierter Nachtrag für den FTGF Putnam Balanced Fund[^] und ein aktualisierter Nachtrag für den FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^] von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 27. Mai 2025 nahm der FTGF Putnam Balanced Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 30. Mai 2025 nahm der FTGF Putnam Global Healthcare Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung zum 7. Juli 2025 wird der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel einstellen.

Mit Wirkung zum 14. Juli 2025 wird der FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^] in FTGF Franklin Global Long-Term Unconstrained Fund[^] und der FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] in FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] umbenannt. Mit Wirkung zum selben Datum wird Martin Currie Investment Management Limited von Franklin Templeton Investment Management Limited als Anlageverwalter abgelöst.

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 19. Juni 2025.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft)

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	0,65	Klasse A USD Thesaurierend	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (D)	0,65	Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,25
Klasse C USD Thesaurierend	1,35	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,25
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,45	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse A (G) USD Thesaurierend	0,65	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,25
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	0,65	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	0,68	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		Klasse C USD Thesaurierend	1,75
Klasse A USD Thesaurierend	1,10	Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,75
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,10	Klasse E USD Thesaurierend	1,90
Klasse C USD Thesaurierend	1,60	Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,91
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,60	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,90
Klasse E USD Thesaurierend	1,73	Klasse F USD Thesaurierend	0,91
Klasse F USD Thesaurierend	0,72	Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,91
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,57	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,61
Klasse X USD Thesaurierend	0,60	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,61
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,60	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	0,45
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,49	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,45
Klasse GA USD Thesaurierend	1,00	Klasse LM USD Ausschüttend (M)	0,15
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15
Klasse A USD Thesaurierend	1,28	Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,36
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,28	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,36
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,28	Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,86
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,28	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	1,85
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,28	Klasse GF USD Thesaurierend	1,11
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,53	FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Klasse C USD Thesaurierend	1,78	Klasse A USD Thesaurierend	1,25
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,78	Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,25
Klasse E USD Thesaurierend	1,89	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,25
Klasse F USD Thesaurierend	0,68	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,70	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
Klasse X USD Thesaurierend	0,60	Klasse A EUR Thesaurierend	1,25
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,60	Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	1,25
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,60	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,43	Klasse C USD Thesaurierend	1,75
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	0,44	Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,75
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45	Klasse E USD Thesaurierend	2,03
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15	Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,03
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,29	Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	2,04
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,30	Klasse F USD Thesaurierend	1,03
Klasse B (G) USD Ausschüttend (D)	1,78	Klasse F USD Ausschüttend (D)	1,03
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,80	Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,93
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	1,80	Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	0,92
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,77
Klasse A USD Thesaurierend	1,40	Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	0,78
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,42	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	0,35
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,42	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,35
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,40	Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,58
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,40	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,58
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,41	Klasse L (G) USD Thesaurierend	2,08
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,41	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	2,08
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,41	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,42	Klasse A USD Thesaurierend	1,42
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,40	Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,42
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,42	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,42
Klasse A ZAR ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,42	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,42
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,66	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,42
Klasse C USD Thesaurierend	1,90	Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	1,42
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,91	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,42
Klasse E USD Thesaurierend	2,01	Klasse A EUR Thesaurierend	1,42
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,01	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,42
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,01	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,42
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	2,02	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse F USD Thesaurierend	0,82	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,42
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,82	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,42
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,86	Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	1,42
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,87	Klasse B USD Thesaurierend	1,67
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	0,87	Klasse C USD Thesaurierend	1,92
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,57	Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,92
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	0,57	Klasse E USD Thesaurierend	2,02
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,55	Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,02
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,55	Klasse F USD Thesaurierend	1,02
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,56	Klasse F USD Ausschüttend (D)	1,02
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,57	Klasse X USD Ausschüttend (M)	0,90
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,57	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,77
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	0,55	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,77
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,45	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,77
LM Klasse AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,16	Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	0,77
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	0,77
		Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)	0,77
		Klasse LM USD Thesaurierend	0,17

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,14	Klasse A USD Thesaurierend	1,55
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,14	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,55
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,13	Klasse A USD Ausschüttend (S)	1,54
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,13	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,60
Klasse C USD Thesaurierend	1,64	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,57
Klasse C USD Ausschüttend (M)	1,62	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,55
Klasse E USD Thesaurierend	1,73	Klasse A EUR Ausschüttend (S)	1,56
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,74	Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,58
Klasse F USD Thesaurierend	0,73	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,56
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,72	Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,58
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,62	Klasse A SGD Thesaurierend	1,53
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,48	Klasse B USD Thesaurierend	1,83
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,48	Klasse C USD Thesaurierend	2,06
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,47	Klasse C USD Ausschüttend (S)	2,06
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,48	Klasse E USD Thesaurierend	2,14
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,50	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,18
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,38	Klasse F USD Thesaurierend	1,33
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,40	Klasse F USD Ausschüttend (S)	1,16
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,38	Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,15
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,38	Klasse X USD Thesaurierend	0,99
		Klasse X USD Ausschüttend (S)	1,06
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,08
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,20	Klasse X GBP Thesaurierend	1,03
Klasse X USD Thesaurierend	0,70	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,04
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,58	Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,06
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,58	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,86
Klasse P1 USD Thesaurierend	0,45	Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	0,89
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,90
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	0,19	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,89
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,92
Klasse A USD Thesaurierend	1,24	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,91
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,23	Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	0,90
Klasse X USD Thesaurierend	0,64	Klasse LM USD Thesaurierend	0,26
Klasse LM USD Thesaurierend	0,30		
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,30	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		Klasse A USD Thesaurierend	1,69
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,55	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,69
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,55	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,69
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)	0,53	Klasse A SGD Thesaurierend	1,79
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,52	Klasse C USD Thesaurierend	2,19
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	0,52	Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,29
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)	0,52	Klasse X USD Thesaurierend	1,20
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,52	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,20
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,52	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,24
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	0,12	Klasse Premier USD Thesaurierend	1,09
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,12	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,09
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,12	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,09
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		Klasse LM USD Thesaurierend	0,19
Klasse D USD Thesaurierend	1,47	FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Klasse D USD Ausschüttend (M)	1,47	Klasse A USD Thesaurierend	1,40
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,47	Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,40
Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,87	Klasse F USD Thesaurierend	0,90
Klasse M USD Ausschüttend (M)	0,87	Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,90
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,72	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,75
Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)	0,72	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,75
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,72	Klasse P2 USD Thesaurierend	0,48
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	0,72	Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,48
Klasse LM USD Thesaurierend	0,12	Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	0,48
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,27	Klasse A USD Thesaurierend	1,45
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,41	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,45
Klasse LM USD Thesaurierend	0,11	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,44
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		Klasse A SGD Thesaurierend	1,45
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	/	Klasse C USD Thesaurierend	1,96
		Klasse E USD Thesaurierend	2,06
		Klasse F USD Thesaurierend	1,05
		Klasse F USD Ausschüttend (M)	1,06
		Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,96
		Klasse Premier USD Thesaurierend	0,81
		Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,81
		Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,16

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF ClearBridge US Value Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,37	Klasse A USD Thesaurierend	1,81
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,37	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,81
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,37	Klasse A EUR Thesaurierend	1,81
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,37	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,81
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,37	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,81
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,37	Klasse A GBP Ausschüttend (A)	1,81
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,37	Klasse A SGD Thesaurierend	1,81
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,38	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,81
Klasse A CZK thesaurierend (Abgesichert)	1,39	Klasse C USD Thesaurierend	2,31
Klasse A EUR Thesaurierend	1,40	Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,31
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,37	Klasse E USD Thesaurierend	2,56
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,37	Klasse F USD Thesaurierend	1,21
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)	1,40	Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,21
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1,40	Klasse X USD Thesaurierend	1,02
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,37	Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,01
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,37	Klasse X EUR Thesaurierend	1,00
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,37	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,79
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,37	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,79
Klasse A HKD Thesaurierend	1,37	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,79
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,37	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,79
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,37	Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,76
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,37	Klasse S USD Thesaurierend	0,64
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	1,37	LM Klasse USD Ausschüttend (A)	0,11
Klasse C USD Thesaurierend	1,87		
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,87	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	
Klasse E USD Thesaurierend	1,97	Klasse A USD Thesaurierend	1,74
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,97	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,74
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,97	Klasse A EUR Thesaurierend	1,75
Klasse F USD Thesaurierend	0,92	Klasse C USD Thesaurierend	2,16
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,93	Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,16
Klasse X USD Thesaurierend	0,73	Klasse E USD Thesaurierend	2,41
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,75	Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,41
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,73	Klasse F USD Thesaurierend	1,15
Klasse X EUR Thesaurierend	0,73	Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,15
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,72	Klasse X USD Ausschüttend (A)	0,96
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,75	Klasse X EUR Thesaurierend	0,96
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,72	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,78
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,72	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,78
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,58	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,77
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,57	Klasse LM USD Thesaurierend	0,15
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,58	Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,40
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,60	Klasse B (G) USD Thesaurierend	1,90
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,57	Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,90
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	0,58	Klasse GA USD Thesaurierend	1,57
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,48	Klasse GA EUR Thesaurierend	1,57
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,48	Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	1,57
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,47	Klasse GE USD Thesaurierend	2,32
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,48	Klasse GE EUR Thesaurierend	2,32
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,48		
Klasse LM USD Thesaurierend	0,13	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	0,13	Klasse A USD Thesaurierend	1,71
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,10	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,71
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,15	Klasse A EUR Thesaurierend	1,71
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,13	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,71
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,13	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,75
		Klasse B USD Thesaurierend	2,20
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,21
Klasse A USD Thesaurierend	1,95	Klasse C USD Thesaurierend	2,21
Klasse X USD Ausschüttend (M)	1,45	Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,21
Klasse Premier USD Thesaurierend	1,30	Klasse E USD Thesaurierend	2,46
		Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,45
FTGF Brandywine Global - US Fixed Income Fund^		Klasse F USD Thesaurierend	1,11
Klasse A USD Thesaurierend	1,10	Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,11
Klasse P1 USD Thesaurierend	0,35	Klasse X USD Thesaurierend	1,05
		Klasse X EUR Thesaurierend	1,05
		Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,06
		Klasse X GBP Thesaurierend	1,05
		Klasse Premier USD Thesaurierend	0,74
		Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,74
		Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,74
		Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,74
		Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,74
		Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	0,74
		Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,74
		Klasse S USD Thesaurierend	0,64
		Klasse S USD Ausschüttend (Q)	0,64
		Klasse S EUR Thesaurierend	0,64
		Klasse LM USD Thesaurierend	0,11
		Klasse LM EUR Thesaurierend	0,12
		Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,36
		Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,86
		Klasse GA USD Thesaurierend	1,53
		Klasse GA EUR Thesaurierend	1,53

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,80	Klasse A USD Thesaurierend	1,80
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,80	Klasse C USD Thesaurierend	2,30
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,82	Klasse E USD Thesaurierend	2,55
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	1,82	Klasse F USD Thesaurierend	1,20
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	1,80	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,80
Klasse A EUR Thesaurierend	1,82	Klasse P2 USD Thesaurierend	0,45
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,82		
Klasse A GBP Thesaurierend	1,80	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	
Klasse A HKD Thesaurierend	1,80	Klasse A USD Thesaurierend	1,97
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,83	Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	1,97
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,81	Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,30	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,96
Klasse C USD Thesaurierend	2,30	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1,97
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,30	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse E USD Thesaurierend	2,57	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,57	Klasse A EUR Thesaurierend	1,97
Klasse E EUR Thesaurierend	2,57	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	1,97
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,56	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,97
Klasse F USD Thesaurierend	1,22	Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	1,97
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,22	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse X USD Thesaurierend	1,05	Klasse C USD Thesaurierend	2,47
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,05	Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	2,47
Klasse X EUR Thesaurierend	1,06	Klasse E USD Thesaurierend	2,72
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,05	Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	2,72
Klasse X GBP Thesaurierend	1,05	Klasse E EUR Thesaurierend	2,73
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,83	Klasse E EUR Ausschüttend (A)	2,72
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,83	Klasse F USD Thesaurierend	1,37
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,82	Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	1,37
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,82	Klasse X USD Thesaurierend	1,07
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	0,82	Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,07
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,47	Klasse X EUR Thesaurierend	1,07
Klasse B (G) USD Thesaurierend	1,97	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	1,08
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,97	Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	1,07
Klasse GA EUR Thesaurierend	1,59	Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	1,08
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	1,59	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,88
Klasse GE USD Thesaurierend	2,34	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,87
Klasse GE EUR Thesaurierend	2,34	Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	0,88
		Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,87
		Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	0,87
		Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,87
		Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	0,87
		Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	0,87
		Klasse S EUR Thesaurierend	0,73
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,75	Klasse A USD Thesaurierend	1,94
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,75	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,94
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,75	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,94
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,94
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1,75	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,94
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,75	Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	1,94
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,75	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,94
Klasse A EUR Thesaurierend	1,75	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,94
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,75	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,94
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,75	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,94
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,75	Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,17
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,75	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,19
Klasse C USD Thesaurierend	2,17	Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	1,18
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,18	Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	1,17
Klasse C USD Ausschüttend (Q)	2,18	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,89
Klasse F USD Thesaurierend	1,15	Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	0,88
Klasse F EUR Thesaurierend	1,15	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,88
Klasse F EUR Ausschüttend (A)	1,15	Klasse S USD Thesaurierend	0,73
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,04	Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73
		Klasse S EUR Thesaurierend	0,73
		Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,72
		Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73
		Klasse S GBP Thesaurierend	0,73
		Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,73
		Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,73
		Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73
		Klasse P2 USD Thesaurierend	0,53
		Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	0,53
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^	
Klasse A USD Thesaurierend	1,67	Klasse A USD Thesaurierend	1,80
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,67	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,79
Klasse A EUR Thesaurierend	1,66	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,79
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,67	Klasse P2 USD Thesaurierend	0,45
Klasse A SEK Thesaurierend	1,50	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45
Klasse F USD Thesaurierend	1,07	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,44
Klasse X USD Thesaurierend	1,03		
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,01		
Klasse X EUR Thesaurierend	1,01		
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,01		
Klasse X GBP Thesaurierend	1,02		
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,01		
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,72		
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,72		
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,75		
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,72		
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,72		
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,52		
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,52		
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,52		
Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,52		
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,52		
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	0,52		
Klasse LM EUR Thesaurierend	0,12		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE(1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025**
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]	
Klasse A USD Thesaurierend	1,96	Klasse A USD Thesaurierend	2,00
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,96	Klasse X USD Thesaurierend	1,12
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,96	Klasse X GBP Thesaurierend	1,07
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	1,96	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,90
Klasse A EUR Thesaurierend	1,97		
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,96	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,96	Klasse A USD Thesaurierend	2,00
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,97	Klasse A EUR Thesaurierend	2,00
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	1,96	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,00
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,96	Klasse C USD Thesaurierend	2,50
Klasse A SGD Thesaurierend	1,96	Klasse E USD Thesaurierend	2,75
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,96	Klasse F USD Thesaurierend	1,40
Klasse B USD Thesaurierend	2,46	Klasse X EUR Thesaurierend	1,16
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,46	Klasse X GBP Thesaurierend	1,15
Klasse C USD Thesaurierend	2,46	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,14
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,46	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,90
Klasse E USD Thesaurierend	2,71	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,55
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,71	Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,55
Klasse E EUR Thesaurierend	2,71		
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,71	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Klasse F USD Thesaurierend	1,37	Klasse A USD Thesaurierend	2,00
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,37	Klasse E USD Thesaurierend	2,75
Klasse R EUR Thesaurierend	1,46	Klasse F USD Thesaurierend	1,40
Klasse X USD Thesaurierend	1,21	Klasse X USD Thesaurierend	1,25
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,22	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,90
Klasse X EUR Thesaurierend	1,22	Klasse P2 USD Thesaurierend	0,70
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,22	Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,70
Klasse X GBP Thesaurierend	1,22		
Klasse X GBP Ausschüttend (A)	1,21	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,87	Klasse A EUR Thesaurierend	2,00
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,87	Klasse X EUR Thesaurierend	1,25
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,87	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,90
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,87	Klasse P1 USD Thesaurierend	0,48
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,87	Klasse P1 EUR Thesaurierend	0,49
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	0,87	Klasse P1 GBP Thesaurierend	0,49
		Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,50
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Klasse A USD Thesaurierend	2,00	Klasse A USD Thesaurierend	2,00
Klasse A USD Ausschüttend (A)	2,04	Klasse X GBP Thesaurierend	1,25
Klasse A EUR Thesaurierend	2,04	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,25
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,04	Klasse P1 USD Thesaurierend	0,15
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	2,04	Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,15
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	2,07	Klasse P1 GBP Thesaurierend	0,15
Klasse C USD Thesaurierend	2,50	Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,54	Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,15
Klasse E USD Thesaurierend	2,79		
Klasse E EUR Thesaurierend	2,79	Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse F USD Thesaurierend	1,44	Klasse A EUR Thesaurierend	0,75
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,44	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	0,75
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,31	Klasse D EUR Thesaurierend	1,30
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,94	Klasse D EUR Ausschüttend (A)	1,30
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,94	Klasse X EUR Thesaurierend	0,35
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	0,94	Klasse X EUR Ausschüttend (A)	0,35
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,65		
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,44	Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]	
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,94	Klasse A EUR Thesaurierend	0,75
		Klasse A EUR Ausschüttend (A)	0,75
		Klasse X EUR Ausschüttend (A)	0,35

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.

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Klasse A USD Thesaurierend	08.05.2007	USD	4,51 %	4,68 %	10,70 %	15,55 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	4,50 %	4,68 %	10,68 %	15,53 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	3,79 %	3,95 %	8,74 %	11,09 %
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	10.10.2018	USD	4,70 %	4,88 %	11,26 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	4,53 %	4,67 %	10,70 %	15,55 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,50 %	4,69 %	10,69 %	15,51 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,50 %	4,69 %	10,72 %	15,54 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	5,33 %	0,36 %	-11,42 %	9,29 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	5,29 %	0,35 %	-11,44 %	9,07 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	4,80 %	-0,15 %	-12,73 %	3,96 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	4,78 %	-0,15 %	-12,75 %	3,79 %
	Klasse E USD Thesaurierend	16.08.2019	USD	4,67 %	-0,25 %	-13,08 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	09.08.2013	USD	5,72 %	0,76 %	-10,29 %	14,77 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	27.02.2017	USD	5,84 %	0,88 %	-10,14 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	13.05.2016	USD	5,85 %	0,86 %	-10,08 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	03.05.2016	USD	5,86 %	0,90 %	-10,05 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	19.04.2017	USD	5,98 %	0,99 %	-9,76 %	–
	Klasse GA USD Thesaurierend	27.08.2010	USD	5,43 %	0,47 %	-11,12 %	11,60 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	3,40 %	-1,56 %	-14,40 %	6,95 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,37 %	-1,56 %	-14,40 %	6,91 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19.02.2016	USD	3,39 %	-1,55 %	-14,40 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	19.02.2016	AUD	2,39 %	-2,75 %	-17,89 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.06.2018	EUR	1,55 %	-3,33 %	-19,70 %	–
	Klasse B USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,13 %	-1,80 %	-15,19 %	4,20 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	2,88 %	-2,05 %	-15,68 %	1,73 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	2,86 %	-2,05 %	-15,67 %	1,70 %
	Klasse E USD Thesaurierend	03.02.2012	USD	2,76 %	-2,15 %	-15,95 %	0,68 %
	Klasse F USD Thesaurierend	05.04.2013	USD	4,00 %	-0,97 %	-12,83 %	14,74 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	31.10.2018	USD	3,97 %	-0,97 %	-12,84 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	20.03.2015	USD	4,10 %	-0,87 %	-12,63 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	28.11.2017	USD	4,07 %	-0,89 %	-12,66 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	10.10.2019	EUR	2,24 %	-2,67 %	-18,16 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	14.09.2010	USD	4,27 %	-0,72 %	-12,17 %	17,66 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	29.09.2011	USD	4,26 %	-0,71 %	-12,16 %	17,57 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.03.2016	EUR	3,28 %	-1,87 %	-17,09 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	19.11.2010	GBP	4,24 %	-0,83 %	-13,41 %	10,91 %
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	3,37 %	-1,57 %	-14,38 %	8,06 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,35 %	-1,56 %	-14,38 %	8,00 %
	Klasse B (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	2,90 %	-2,01 %	-15,60 %	3,08 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	2,86 %	-2,05 %	-15,65 %	2,79 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	2,85 %	-2,05 %	-15,65 %	2,75 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	5,72 %	3,36 %	-2,06 %	22,53 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	5,68 %	3,34 %	-2,09 %	22,40 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	19.02.2008	USD	5,70 %	3,35 %</		

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)	Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	27.06.2016	GBP	5,96 %	3,54 %	-2,32 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	10.09.2008	USD	6,61 %	4,22 %	0,46 %	33,38 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	06.02.2009	USD	6,61 %	4,23 %	0,48 %	33,40 %
	Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	01.12.2022	CHF	2,06 %	-0,21 %	–	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	17.12.2009	EUR	4,82 %	2,48 %	-5,55 %	10,75 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	23.11.2012	EUR	4,79 %	2,47 %	-5,47 %	10,79 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	18.04.2008	GBP	6,32 %	3,89 %	-1,33 %	22,57 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	05.02.2013	GBP	6,32 %	3,90 %	-1,30 %	22,93 %
	Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	08.10.2015	PLN	7,19 %	4,61 %	6,15 %	–
	Klasse LM AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)	03.12.2010	AUD	6,11 %	3,51 %	-1,95 %	34,17 %
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	03.12.2010	GBP	6,71 %	4,31 %	-0,17 %	27,71 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	9,94 %	7,63 %	3,22 %	43,79 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	9,87 %	7,60 %	3,17 %	43,56 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	20.12.2010	USD	9,94 %	7,64 %	3,22 %	43,77 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	9,94 %	7,64 %	3,23 %	43,78 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	19.12.2012	EUR	8,14 %	5,87 %	-2,88 %	19,67 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	21.08.2023	HKD	9,26 %	7,43 %	–	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	31.01.2013	SGD	7,90 %	5,69 %	-0,41 %	35,53 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	9,38 %	7,09 %	1,69 %	36,77 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	9,35 %	7,08 %	1,65 %	36,52 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	9,21 %	6,94 %	1,32 %	35,30 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	9,16 %	6,92 %	1,24 %	34,99 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	25.09.2019	EUR	7,32 %	5,09 %	-4,68 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	10,31 %	8,01 %	4,46 %	51,72 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	04.01.2011	USD	10,20 %	7,95 %	4,39 %	51,04 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	08.11.2010	USD	10,64 %	8,32 %	5,29 %	55,59 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	09.08.2019	GBP	10,50 %	8,01 %	3,60 %	–
	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	09.03.2022	USD	10,92 %	8,62 %	–	–
	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	9,09 %	6,80 %	–	–
	Klasse LM USD Ausschüttend (M)	27.05.2008	USD	11,16 %	8,82 %	6,74 %	62,82 %
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	12.06.2020	GBP	10,84 %	8,45 %	4,63 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	9,82 %	7,53 %	3,06 %	45,00 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	9,74 %	7,49 %	3,03 %	44,74 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	9,27 %	7,00 %	1,53 %	37,92 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	9,19 %	6,94 %	1,48 %	37,67 %
	Klasse GF USD Thesaurierend	19.11.2010	USD	10,09 %	7,78 %	3,72 %	48,01 %
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	9,45 %	7,43 %	-0,35 %	33,17 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	9,39 %	7,40 %	-0,38 %	33,18 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	30.01.2008	USD	9,46 %	7,43 %	-0,35 %	33,09 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	9,46 %	7,44 %	-0,35 %	33,08 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.06.2010	AUD	8,48 %	6,26 %	-4,14 %	27,95 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	23.05.2017	EUR	14,06 %	14,50 %	9,49 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	25.09.2012	EUR	7,62 %	5,60 %	-6,29 %	10,46 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	7,54 %	5,56 %	-3,93 %	25,44 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	8,91 %	6,90 %	-1,84 %	26,68 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	8,86 %	6,87 %	-1,86 %	26,69 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	8,61 %	6,61 %	-2,43 %	24,90 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	8,56 %	6,58 %	-2,45 %	24,88 %
	Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	02.08.2013	EUR	6,81 %	4,84 %	-8,34 %	3,78 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	9,70 %	7,67 %	0,61 %	40,99 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	04.01.2011	USD	9,63 %	7,65 %	0,55 %	40,75 %
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	21.03.2018	USD	9,69 %	7,75 %	0,85 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	15.01.2013	GBP	9,48 %	7,41 %	-1,10 %	29,15 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.10.2012	EUR	8,12 %	6,11 %	-4,75 %	20,01 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	12.08.2011	GBP	9,62 %	7,58 %	-0,60 %	32,23 %
	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	09.03.2022	USD	10,55 %	8,48 %	–	–
	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	8,63 %	6,59 %	–	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	9,10 %	7,08 %	-1,03 %	33,47 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	9,05 %	7,06 %	-1,06 %	33,47 %

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,55 %	6,55 %	-2,51 %	26,95 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	8,48 %	6,54 %	-2,51 %	27,00 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Klasse A USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	3,55 %	1,56 %	-4,28 %	12,75 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	02.07.2008	USD	3,52 %	1,55 %	-4,26 %	12,64 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	07.01.2010	USD	3,55 %	1,56 %	-4,28 %	12,74 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	3,55 %	1,56 %	-4,27 %	12,74 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M)						
	(Abgesichert) Plus	28.09.2011	AUD	2,59 %	0,44 %	-7,55 %	9,37 %
	Klasse A CHF Thesaurierend						
	(Abgesichert)	26.01.2015	CHF	-0,89 %	-2,73 %	-14,25 %	-14,18 %
	Klasse A CNH Ausschüttend (M)						
	(Abgesichert) Plus	20.06.2013	CNH	0,88 %	-1,34 %	-9,39 %	22,30 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	02.07.2008	EUR	7,93 %	8,28 %	5,33 %	21,71 %
	Klasse A EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	19.05.2011	EUR	1,72 %	-0,20 %	-9,84 %	-6,60 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	01.04.2011	EUR	7,93 %	8,28 %	5,28 %	21,64 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M)						
	Plus	27.10.2015	HKD	2,87 %	1,03 %	-4,67 %	–
	Klasse A SGD Thesaurierend						
	(Abgesichert)	19.05.2009	SGD	1,57 %	-0,35 %	-7,62 %	5,96 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M)						
	(Abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	1,52 %	-0,34 %	-7,69 %	5,82 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	04.08.2010	SGD	4,01 %	5,14 %	-3,05 %	11,01 %
	Klasse B USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	3,28 %	1,30 %	-4,99 %	9,94 %
	Klasse C USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	3,03 %	1,05 %	-5,70 %	7,24 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	02.07.2008	USD	3,01 %	1,04 %	-5,69 %	7,14 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	2,93 %	0,95 %	-5,99 %	6,18 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	2,91 %	0,95 %	-5,96 %	6,09 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.02.2010	USD	3,97 %	1,97 %	-3,12 %	17,34 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	3,94 %	1,95 %	-3,09 %	17,37 %
	Klasse X USD Ausschüttend (M)	07.05.2015	USD	4,09 %	2,08 %	-2,83 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	4,23 %	2,22 %	-2,40 %	20,31 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	03.09.2010	EUR	8,38 %	8,69 %	7,03 %	29,44 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	10.03.2011	EUR	2,39 %	0,47 %	-8,05 %	-0,15 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend						
	(A)	09.01.2013	EUR	8,60 %	8,95 %	7,27 %	29,64 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend						
	(M)	08.09.2010	EUR	8,60 %	8,94 %	7,28 %	29,86 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend						
	(M)	16.07.2010	GBP	4,59 %	4,08 %	5,53 %	47,90 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	12.06.2008	USD	4,85 %	2,84 %	-0,63 %	27,75 %
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	25.06.2009	USD	5,67 %	3,90 %	2,82 %	14,70 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	02.06.2009	USD	5,68 %	3,90 %	2,82 %	14,74 %
	Klasse A EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	30.01.2014	EUR	3,91 %	2,17 %	-3,05 %	-4,38 %
	Klasse A SEK Thesaurierend						
	(Abgesichert)	23.06.2020	SEK	3,70 %	2,03 %	-2,69 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	25.06.2009	USD	5,14 %	3,39 %	1,30 %	9,13 %
	Klasse C USD Ausschüttend (M)	25.06.2009	USD	5,15 %	3,39 %	1,29 %	9,12 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	5,04 %	3,29 %	1,00 %	8,06 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	5,02 %	3,29 %	0,96 %	8,01 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.02.2010	USD	6,09 %	4,32 %	4,06 %	19,42 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	22.06.2020	USD	6,34 %	4,37 %	4,08 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	17.06.2020	EUR	4,35 %	2,59 %	-1,66 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	02.06.2009	USD	6,37 %	4,59 %	4,85 %	22,70 %
	Klasse Premier CHF Ausschüttend						
	(M) (Abgesichert)	17.07.2023	CHF	1,87 %	0,19 %	–	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	01.03.2019	EUR	4,63 %	2,87 %	-1,13 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend						
	(Abgesichert)	02.06.2009	GBP	6,21 %	4,35 %	3,18 %	13,60 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend						
	(M) (Abgesichert)	02.06.2009	GBP	6,22 %	4,35 %	3,18 %	13,82 %
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Klasse P2 USD Ausschüttend (M)						
	Plus (e)	15.12.2017	USD	6,49 %	4,69 %	5,16 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	15.10.2021	EUR	4,86 %	3,11 %	-0,71 %	–
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (M)						
	(Abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	EUR	4,68 %	2,94 %	-0,80 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (M)						
	(Abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	GBP	6,27 %	4,42 %	3,47 %	–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Klasse A USD Ausschüttend (A)	05.03.2015	USD	3,81 %	-0,21 %	-8,04 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	17.02.2015	USD	3,79 %	-0,13 %	-7,50 %	12,15 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	03.12.2010	USD	3,91 %	-0,01 %	-7,08 %	15,01 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend						
	(Abgesichert)	27.06.2014	EUR	2,04 %	-1,82 %	-12,71 %	-4,58 %
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Klasse P1 USD Thesaurierend	09.03.2022	USD	4,25 %	0,25 %	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	2,49 %	-1,44 %	–	–
	Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	17.10.2018	CAD	3,19 %	-0,59 %	-7,76 %	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	15.11.2011	USD	6,50 %	3,25 %	-8,32 %	19,99 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	15.11.2011	EUR	4,71 %	1,51 %	-13,79 %	-0,39 %
	Klasse X USD Thesaurierend	06.03.2023	USD	7,07 %	3,87 %	–	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	27.01.2011	USD	7,48 %	4,23 %	-5,59 %	34,30 %
	Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	15.01.2021	EUR	5,65 %	2,44 %	-11,22 %	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	16.12.2015	USD	6,91 %	4,43 %	-1,79 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.01.2017	EUR	4,78 %	2,43 %	-7,83 %	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	15.01.2021	USD	7,73 %	5,28 %	0,99 %	–
	Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	26.11.2021	CHF	10,01 %	13,64 %	0,62 %	–
	Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	25.07.2022	CHF	3,19 %	0,87 %	–	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	18.11.2019	EUR	5,91 %	3,49 %	-4,95 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	20.11.2019	GBP	7,44 %	4,92 %	-0,89 %	–
	Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	28.02.2022	CAD	7,01 %	4,73 %	–	–
	Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	25.07.2019	EUR	6,32 %	3,91 %	-3,85 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	16.12.2015	GBP	7,86 %	5,35 %	0,30 %	–
	Klasse D USD Thesaurierend	24.01.2018	USD	9,43 %	9,11 %	5,90 %	–
	Klasse D USD Ausschüttend (M)	14.02.2018	USD	9,43 %	9,11 %	5,88 %	–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.05.2018	EUR	7,66 %	7,35 %	0,20 %	–
	Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	30.05.2018	CHF	5,50 %	5,30 %	-2,98 %	–
	Klasse M USD Ausschüttend (M)	28.11.2018	USD	10,08 %	9,75 %	7,81 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	04.05.2016	USD	10,26 %	9,93 %	8,30 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)	13.12.2017	USD	10,24 %	9,92 %	8,28 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	04.05.2016	EUR	8,47 %	8,16 %	2,33 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	27.12.2017	EUR	8,49 %	8,18 %	2,41 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	13.01.2016	USD	10,92 %	10,59 %	10,26 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	13.01.2016	USD	5,56 %	0,52 %	-9,46 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	15.06.2022	USD	6,50 %	1,40 %	–	–
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Klasse LM USD Thesaurierend	13.01.2016	USD	6,81 %	1,71 %	-6,22 %	–
	Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	11.01.2021	USD	3,62 %	-2,11 %	-18,34 %	–
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	0,10 %	-5,86 %	-18,20 %	-17,14 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	06.12.2010	USD	0,10 %	-5,86 %	-18,20 %	-17,14 %
	Klasse A USD Ausschüttend (S)	01.10.2003	USD	0,09 %	-5,86 %	-18,19 %	-17,15 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.07.2014	AUD	-0,72 %	-6,92 %	-21,90 %	-22,42 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.02.2013	EUR	-1,66 %	-7,57 %	-23,82 %	-33,04 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	07.06.2013	EUR	-1,68 %	-7,54 %	-23,80 %	-33,08 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (S)	14.10.2016	EUR	4,30 %	0,33 %	-10,15 %	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	14.11.2014	GBP	-0,33 %	-6,25 %	-20,68 %	-26,33 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	08.06.2015	SGD	0,48 %	-2,67 %	-17,24 %	–
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	-0,15 %	-6,10 %	-18,80 %	-19,17 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	-0,39 %	-6,32 %	-19,41 %	-21,18 %
	Klasse C USD Ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	-0,39 %	-6,33 %	-19,41 %	-21,18 %
	Klasse E USD Thesaurierend	08.09.2011	USD	-0,50 %	-6,43 %	-19,66 %	-21,97 %
	Klasse F USD Thesaurierend	14.09.2012	USD	0,49 %	-5,48 %	-17,20 %	-13,76 %
	Klasse F USD Ausschüttend (S)	04.10.2012	USD	0,51 %	-5,48 %	-17,20 %	-13,75 %
	Klasse X USD Thesaurierend	04.06.2013	USD	0,61 %	-5,37 %	-16,95 %	-12,88 %
	Klasse X USD Ausschüttend (S)	26.03.2013	USD	0,61 %	-5,39 %	-16,97 %	-12,89 %
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	28.06.2013	EUR	-1,19 %	-7,09 %	-22,64 %	-29,64 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	23.12.2014	GBP	0,92 %	-3,71 %	-10,33 %	6,23 %
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	0,14 %	-5,91 %	-19,82 %	-22,80 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	25.02.2013	GBP	0,17 %	-5,80 %	-19,60 %	-22,74 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.03.2011	USD	0,75 %	-5,24 %	-16,58 %	-11,58 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	24.02.2012	USD	0,75 %	-5,24 %	-16,58 %	-11,57 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	25.01.2011	EUR	4,99 %	1,01 %	-8,31 %	-5,17 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.01.2013	EUR	-1,20 %	-7,17 %	-22,46 %	-28,82 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	15.09.2021	GBP	0,28 %	-5,70 %	-19,35 %	–
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	0,37 %	-5,68 %	-19,25 %	-21,62 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	28.03.2019	USD	1,36 %	-4,69 %	-15,08 %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	03.04.2012	USD	2,55 %	-2,05 %	-4,66 %	3,22 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	17.09.2013	USD	2,55 %	-2,05 %	-4,66 %	3,29 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	18.06.2013	EUR	0,63 %	-3,86 %	-10,83 %	-15,02 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	17.05.2022	SGD	3,04 %	1,32 %	–	–
	Klasse C USD Thesaurierend	17.07.2013	USD	2,04 %	-2,55 %	-6,09 %	-1,84 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	27.08.2013	USD	1,93 %	-2,64 %	-6,37 %	-2,79 %
	Klasse X USD Thesaurierend	16.03.2018	USD	3,05 %	-1,56 %	-3,32 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	16.06.2014	GBP	2,67 %	-1,98 %	-5,59 %	-1,88 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	21.01.2014	GBP	2,60 %	-2,01 %	-5,68 %	-1,96 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	25.03.2013	USD	3,17 %	-1,46 %	-2,94 %	9,59 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.07.2012	EUR	1,29 %	-3,28 %	-9,17 %	-9,55 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	25.03.2013	GBP	2,70 %	-1,96 %	-5,31 %	-0,55 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	12.06.2014	USD	4,10 %	-0,58 %	-0,29 %	19,91 %
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	14.10.2016	USD	8,83 %	8,19 %	7,81 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	18.07.2016	USD	8,86 %	8,27 %	7,99 %	–
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	08.02.2024	USD	9,47 %	–	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	30.11.2012	USD	9,59 %	8,95 %	10,12 %	54,83 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	30.11.2012	GBP	10,31 %	10,08 %	11,08 %	47,76 %
	Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	23.02.2016	CAD	9,75 %	9,72 %	11,66 %	–
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	24.03.2023	EUR	9,10 %	8,93 %	–	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	06.05.2011	USD	-2,99 %	-10,39 %	-21,10 %	-11,95 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	25.06.2010	USD	-2,98 %	-10,38 %	-21,10 %	-11,97 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	04.04.2018	EUR	-4,92 %	-12,13 %	-26,41 %	–
	Klasse A SGD Thesaurierend	17.04.2020	SGD	-2,60 %	-7,35 %	-20,43 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	21.03.2012	USD	-3,48 %	-10,84 %	-22,28 %	-16,26 %
	Klasse E USD Thesaurierend	17.02.2012	USD	-3,57 %	-10,92 %	-22,51 %	-17,09 %
	Klasse F USD Thesaurierend	22.07.2014	USD	-2,61 %	-10,03 %	-20,15 %	-8,37 %
	Klasse F USD Ausschüttend (M)	19.07.2013	USD	-2,60 %	-10,03 %	-20,16 %	-8,40 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	-3,14 %	-10,56 %	-22,98 %	-18,16 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	06.01.2012	USD	-2,36 %	-9,81 %	-19,55 %	-6,05 %
	Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	19.09.2012	NZD	-0,44 %	-5,90 %	-10,85 %	10,79 %
	Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	13.01.2012	NZD	0,20 %	-5,30 %	-9,16 %	18,06 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Klasse A USD Thesaurierend	30.08.2013	USD	4,46 %	1,47 %	-7,08 %	29,72 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	26.08.2020	USD	4,45 %	1,47 %	-7,09 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	28.08.2020	USD	4,39 %	1,44 %	-7,13 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	15.01.2021	USD	4,46 %	1,47 %	-7,08 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	4,46 %	1,47 %	-7,09 %	29,72 %
	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	23.06.2021	AUD	3,63 %	0,51 %	-10,62 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	AUD	3,66 %	0,58 %	-10,53 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	15.04.2021	CNH	1,77 %	-1,43 %	-12,20 %	–
	Klasse A CZK thesaurierend (Abgesichert)	20.05.2022	CZK	3,78 %	1,11 %	–	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	25.11.2020	EUR	8,93 %	8,19 %	2,38 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	22.08.2016	EUR	2,74 %	-0,18 %	-12,94 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	19.05.2015	EUR	2,81 %	-0,10 %	-12,87 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	EUR	2,66 %	-0,24 %	-13,01 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	21.10.2013	EUR	2,72 %	-0,22 %	-12,97 %	7,14 %
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	GBP	4,14 %	1,18 %	-9,32 %	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	24.10.2013	GBP	4,18 %	1,19 %	-9,27 %	18,55 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)	Klasse A HKD Thesaurierend	30.08.2021	HKD	3,75 %	0,91 %	-7,49 %	–
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	09.04.2021	HKD	3,75 %	0,91 %	-7,49 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	21.10.2015	SGD	2,57 %	-0,46 %	-10,55 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	17.02.2021	SGD	2,42 %	-0,44 %	-10,58 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	29.01.2021	SGD	4,89 %	4,94 %	-6,10 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	23.09.2020	USD	3,93 %	0,96 %	-8,46 %	–
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	24.11.2020	USD	3,90 %	0,96 %	-8,46 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	21.04.2020	USD	3,83 %	0,85 %	-8,74 %	–
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	22.01.2021	USD	3,80 %	0,86 %	-8,73 %	–
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	03.04.2017	EUR	1,98 %	-0,91 %	-14,65 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	22.10.2020	USD	4,93 %	1,93 %	-5,82 %	–
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	24.07.2019	USD	4,87 %	1,90 %	-5,84 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	25.09.2020	USD	5,15 %	2,13 %	-5,35 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	18.07.2017	USD	5,56 %	2,56 %	-5,12 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	21.01.2014	USD	5,14 %	2,13 %	-5,34 %	37,61 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	17.02.2021	EUR	9,50 %	8,74 %	3,94 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	16.02.2021	EUR	3,18 %	0,26 %	-11,54 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	23.12.2013	EUR	3,30 %	0,37 %	-11,40 %	13,45 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20.12.2013	GBP	4,80 %	1,75 %	-7,66 %	25,52 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	09.10.2020	USD	5,30 %	2,28 %	-4,92 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	5,29 %	2,27 %	-4,93 %	39,64 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	07.10.2014	EUR	3,47 %	0,56 %	-10,97 %	15,38 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	13.12.2013	EUR	3,59 %	0,65 %	-10,89 %	15,30 %
	Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	22.10.2014	SEK	3,35 %	0,55 %	-10,86 %	15,00 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	06.07.2020	USD	5,41 %	2,38 %	-4,55 %	–
	Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	14.09.2021	USD	5,40 %	2,38 %	-4,56 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	10.04.2018	EUR	3,62 %	0,68 %	-10,64 %	–
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	18.09.2018	EUR	3,72 %	0,77 %	-10,50 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	01.02.2018	GBP	5,10 %	2,07 %	-6,90 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	06.07.2022	USD	5,78 %	2,74 %	–	–
	Klasse LM USD Ausschüttend (M)	30.09.2021	USD	5,77 %	2,74 %	-3,54 %	–
	Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	28.02.2024	USD	5,88 %	–	–	–
	Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	11.08.2021	EUR	4,12 %	1,16 %	-9,51 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	08.10.2020	GBP	5,54 %	2,48 %	-5,78 %	–
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^A	Klasse A USD Thesaurierend	30.06.2014	USD	8,59 %	7,99 %	5,27 %	19,40 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	30.04.2021	USD	9,20 %	8,58 %	7,42 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	30.06.2014	USD	9,30 %	8,69 %	7,33 %	27,42 %
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund ^A	Klasse A USD Thesaurierend	06.11.2023	USD	4,83 %	-0,09 %	–	–
	Klasse P1 USD Thesaurierend	06.11.2023	USD	5,28 %	0,37 %	–	–
FTGF ClearBridge US Value Fund	Klasse A USD Thesaurierend	24.04.2007	USD	14,60 %	13,77 %	22,17 %	122,54 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	23.03.1998	USD	14,59 %	13,77 %	22,17 %	122,54 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.06.2007	EUR	19,39 %	21,24 %	34,34 %	139,48 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.09.2022	EUR	12,65 %	11,92 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	02.09.2014	EUR	12,54 %	11,80 %	13,17 %	81,86 %
	Klasse A GBP ausschüttend (A)	28.08.2014	GBP	15,06 %	15,84 %	31,92 %	172,44 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	18.05.2007	SGD	15,04 %	17,73 %	23,79 %	120,32 %
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	10.09.2012	SGD	12,40 %	11,61 %	16,86 %	104,58 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	14,02 %	13,21 %	20,35 %	111,70 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	14,02 %	13,21 %	20,35 %	111,68 %
	Klasse E USD Thesaurierend	26.03.2021	USD	13,74 %	12,92 %	19,45 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	15,29 %	14,45 %	24,38 %	137,03 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	19.10.2016	USD	15,28 %	14,46 %	24,37 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	08.03.2022	USD	15,50 %	14,63 %	–	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	07.10.2013	USD	15,50 %	14,63 %	24,76 %	138,34 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	22.02.2021	EUR	20,30 %	22,15 %	37,12 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	01.07.2008	USD	15,78 %	14,94 %	25,98 %	146,56 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	25.04.2014	USD	15,77 %	14,94 %	25,97 %	146,51 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	30.06.2014	EUR	20,57 %	22,45 %	38,35 %	164,15 %

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF ClearBridge US Value Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	08.04.2021	EUR	13,74 %	12,99 %	16,83 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	21.12.2023	GBP	16,34 %	17,16 %	–	–
	Klasse S USD Thesaurierend	30.11.2023	USD	15,96 %	15,11 %	–	–
	LM Klasse USD Ausschüttend (A)	21.07.2021	USD	16,56 %	15,72 %	28,55 %	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	14,17 %	21,09 %	20,87 %	159,61 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	14,17 %	21,09 %	20,87 %	159,62 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	03.06.2008	EUR	19,01 %	29,12 %	32,88 %	180,11 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	13,69 %	20,55 %	19,14 %	147,13 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	13,69 %	20,55 %	19,15 %	147,14 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	13,40 %	20,25 %	18,25 %	140,99 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	21.01.2010	USD	13,41 %	20,25 %	18,22 %	140,93 %
	Klasse F USD Thesaurierend	17.09.2012	USD	14,86 %	21,81 %	23,03 %	175,55 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.02.2010	USD	14,86 %	21,81 %	23,03 %	175,54 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	07.10.2013	USD	15,07 %	21,98 %	23,27 %	176,66 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	07.10.2013	EUR	19,86 %	29,98 %	35,47 %	198,87 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	06.05.2010	USD	15,29 %	22,27 %	24,43 %	186,12 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	09.04.2009	USD	15,29 %	22,27 %	24,42 %	186,06 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	07.06.2010	EUR	20,06 %	30,26 %	36,86 %	208,75 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	05.04.2016	USD	16,01 %	23,03 %	26,77 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	14,57 %	21,51 %	22,11 %	168,75 %
	Klasse B (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	14,00 %	20,91 %	20,22 %	155,09 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	14,00 %	20,90 %	20,30 %	155,64 %
	Klasse GA USD Thesaurierend	10.06.2011	USD	14,37 %	21,30 %	21,49 %	164,20 %
	Klasse GA EUR Thesaurierend	10.06.2011	EUR	19,17 %	29,28 %	33,56 %	185,10 %
	Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	10.06.2011	EUR	19,16 %	29,27 %	33,53 %	185,02 %
	Klasse GE USD Thesaurierend	10.06.2011	USD	13,52 %	20,40 %	18,79 %	145,12 %
	Klasse GE EUR Thesaurierend	10.06.2011	EUR	18,27 %	28,30 %	30,57 %	164,80 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	12,59 %	25,69 %	20,24 %	233,06 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	12,59 %	25,69 %	20,24 %	233,10 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	27.08.2008	EUR	17,31 %	33,95 %	32,13 %	258,53 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	05.02.2016	EUR	10,60 %	23,58 %	11,61 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	20.11.2023	EUR	17,44 %	34,13 %	–	–
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	12,07 %	25,10 %	18,48 %	216,90 %
	Klasse B USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	12,03 %	25,06 %	18,45 %	216,81 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	12,03 %	25,06 %	18,45 %	216,80 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	12,03 %	25,06 %	18,45 %	216,81 %
	Klasse E USD Thesaurierend	14.01.2016	USD	11,75 %	24,75 %	17,57 %	–
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	13.10.2015	USD	11,75 %	24,75 %	17,57 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	19.04.2016	USD	13,27 %	26,44 %	22,42 %	–
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.11.2015	USD	13,27 %	26,44 %	22,42 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	29.09.2015	USD	13,33 %	26,50 %	22,54 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	17.01.2018	EUR	18,12 %	34,86 %	34,61 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	27.07.2016	EUR	11,40 %	24,45 %	13,70 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	04.12.2015	GBP	13,71 %	28,77 %	32,43 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	19.09.2014	USD	13,69 %	26,92 %	23,81 %	267,13 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	21.02.2020	USD	13,70 %	26,92 %	23,80 %	–
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	17,86 %	31,04 %	44,29 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	15.09.2016	EUR	18,45 %	35,25 %	36,02 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.03.2016	EUR	11,72 %	24,85 %	14,92 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	21.02.2020	EUR	18,57 %	35,39 %	36,24 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	02.12.2015	GBP	14,08 %	29,22 %	33,88 %	–
	Klasse S USD Thesaurierend	02.03.2018	USD	13,81 %	27,05 %	24,17 %	–
	Klasse S USD Ausschüttend (Q)	14.12.2023	USD	13,82 %	27,04 %	–	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	02.03.2018	EUR	18,56 %	35,37 %	36,49 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	05.04.2016	USD	14,41 %	27,71 %	26,15 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	12,99 %	26,13 %	21,51 %	244,91 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	12,42 %	25,50 %	19,70 %	228,09 %
	Klasse GA USD Thesaurierend	27.08.2010	USD	12,79 %	25,91 %	20,89 %	239,10 %
	Klasse GA EUR Thesaurierend	27.08.2010	EUR	17,52 %	34,19 %	32,88 %	265,89 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,70 %	10,82 %	0,62 %	50,77 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	8,71 %	10,81 %	0,62 %	50,83 %
	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	03.06.2013	AUD	7,10 %	9,16 %	-5,89 %	33,63 %
	Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	23.10.2014	CHF	4,33 %	6,49 %	-10,61 %	14,78 %
	Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	14.11.2014	CNH	5,99 %	7,82 %	-5,40 %	61,63 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	07.09.2010	EUR	13,19 %	18,07 %	10,55 %	62,06 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.04.2013	EUR	6,68 %	8,85 %	-6,75 %	23,20 %
	Klasse A GBP Thesaurierend	29.09.2014	GBP	9,02 %	12,76 %	8,76 %	84,97 %
	Klasse A HKD Thesaurierend	27.10.2015	HKD	7,93 %	10,18 %	0,16 %	–
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SEK	6,36 %	8,63 %	-7,41 %	17,53 %

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SGD	6,60 %	8,67 %	-3,86 %	38,30 %
	Klasse B USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	8,15 %	10,25 %	-0,88 %	43,41 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	8,16 %	10,26 %	-0,88 %	43,42 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	8,16 %	10,26 %	-0,88 %	43,41 %
	Klasse E USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	7,86 %	9,98 %	-1,63 %	39,84 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	7,86 %	9,97 %	-1,63 %	39,84 %
	Klasse E EUR Thesaurierend	16.03.2021	EUR	12,39 %	17,20 %	8,08 %	–
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	10.09.2013	EUR	5,86 %	8,04 %	-8,84 %	14,48 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	9,34 %	11,47 %	2,43 %	60,05 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	9,33 %	11,47 %	2,43 %	60,05 %
	Klasse X USD Thesaurierend	17.05.2013	USD	9,52 %	11,62 %	2,68 %	61,05 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	13.02.2013	USD	9,53 %	11,62 %	2,67 %	61,06 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	21.01.2014	EUR	14,06 %	18,93 %	12,83 %	73,72 %
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.02.2014	EUR	7,52 %	9,67 %	-4,90 %	31,51 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	24.04.2013	GBP	9,88 %	13,64 %	10,99 %	97,03 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	17.03.2010	USD	9,78 %	11,92 %	3,66 %	66,58 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	14.12.2010	EUR	14,36 %	19,25 %	13,93 %	79,15 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	27.02.2017	GBP	10,14 %	13,93 %	12,00 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	22.04.2014	GBP	9,33 %	11,49 %	-0,17 %	46,05 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	13.12.2012	GBP	10,13 %	13,92 %	12,02 %	104,09 %
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	9,06 %	11,19 %	1,67 %	56,10 %
	Klasse B (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,49 %	10,62 %	0,16 %	48,56 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,52 %	10,63 %	0,15 %	48,48 %
	Klasse GA EUR Thesaurierend	27.08.2010	EUR	13,49 %	18,35 %	11,34 %	66,23 %
	Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	13,49 %	18,36 %	11,34 %	66,15 %
	Klasse GE USD Thesaurierend	27.08.2010	USD	8,11 %	10,23 %	-0,95 %	43,10 %
	Klasse GE EUR Thesaurierend	27.08.2010	EUR	12,64 %	17,47 %	8,86 %	54,30 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	13.08.2013	USD	15,42 %	17,72 %	13,05 %	66,32 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	15,43 %	17,72 %	13,05 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19.06.2014	USD	15,42 %	17,72 %	13,05 %	66,32 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	15,39 %	17,68 %	12,99 %	66,27 %
	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	08.05.2015	USD	15,42 %	17,73 %	13,05 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	25.06.2014	AUD	14,11 %	16,28 %	6,71 %	50,85 %
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.07.2014	CNH	12,51 %	14,53 %	6,59 %	78,42 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	27.03.2015	EUR	20,28 %	25,48 %	24,27 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.11.2014	EUR	13,38 %	15,78 %	5,20 %	36,51 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	27.02.2014	EUR	13,38 %	15,79 %	5,24 %	36,51 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	28.07.2014	HKD	14,62 %	17,05 %	12,48 %	65,70 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.07.2014	SGD	13,17 %	15,60 %	8,30 %	53,57 %
	Klasse C USD Thesaurierend	27.09.2013	USD	14,92 %	17,20 %	11,43 %	58,32 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	14,92 %	17,20 %	11,43 %	–
	Klasse C USD Ausschüttend (Q)	29.08.2014	USD	14,92 %	17,20 %	11,43 %	58,30 %
	Klasse F USD Thesaurierend	27.03.2015	USD	16,12 %	18,44 %	15,10 %	–
	Klasse F EUR Thesaurierend	27.03.2015	EUR	20,98 %	26,21 %	26,51 %	–
	Klasse F EUR Ausschüttend (A)	27.03.2015	EUR	21,01 %	26,24 %	26,54 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	24.04.2017	EUR	14,15 %	16,56 %	7,22 %	–
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Klasse A USD Thesaurierend	11.03.2020	USD	7,29 %	13,18 %	1,18 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	7,29 %	13,18 %	1,19 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	28.02.2022	EUR	11,83 %	20,61 %	–	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.09.2015	EUR	5,35 %	11,21 %	-6,17 %	–
	Klasse A SEK Thesaurierend	21.01.2020	SEK	11,61 %	24,35 %	24,46 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	11.03.2020	USD	7,94 %	13,87 %	3,03 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	30.07.2020	USD	8,00 %	13,91 %	3,06 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	8,00 %	13,91 %	3,06 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	24.03.2021	EUR	12,48 %	21,35 %	13,45 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.09.2015	EUR	6,08 %	11,97 %	-4,23 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	22.12.2015	GBP	8,29 %	15,89 %	11,18 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	18.12.2019	GBP	7,41 %	13,31 %	-0,52 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.06.2020	USD	8,31 %	14,26 %	4,10 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	8,31 %	14,26 %	4,10 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	27.05.2022	EUR	13,04 %	21,97 %	–	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.09.2015	EUR	6,39 %	12,31 %	-3,27 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	30.09.2015	GBP	8,61 %	16,25 %	12,32 %	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	11.07.2018	USD	8,53 %	14,49 %	4,73 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend	13.07.2020	EUR	13,07 %	22,02 %	15,08 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	13.07.2020	EUR	6,72 %	12,68 %	-2,60 %	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund – (Fortsetzung)	Klasse P2 GBP Thesaurierend	31.07.2019	GBP	8,87 %	16,52 %	13,15 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	19.11.2019	GBP	8,00 %	13,91 %	1,06 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	31.07.2019	GBP	8,88 %	16,54 %	13,25 %	–
	Klasse LM EUR Thesaurierend	21.05.2021	EUR	13,52 %	22,47 %	16,42 %	–
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	Klasse A USD Thesaurierend	29.06.2018	USD	14,89 %	18,23 %	9,86 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	29.06.2018	USD	16,04 %	19,43 %	13,20 %	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	10.11.2017	USD	9,43 %	3,45 %	3,53 %	–
	Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	16.03.2017	USD	15,82 %	12,00 %	20,16 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	19.06.2017	USD	15,57 %	11,89 %	19,89 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	04.12.2023	USD	9,34 %	3,43 %	–	–
	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	12.12.2016	USD	9,35 %	3,45 %	3,55 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M)	24.10.2019	AUD	14,69 %	10,69 %	14,89 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M)	24.10.2019	CNH	12,83 %	8,91 %	13,91 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.12.2016	EUR	13,98 %	10,27 %	13,91 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	03.12.2019	EUR	11,21 %	6,71 %	6,71 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	26.04.2022	EUR	14,02 %	10,21 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	22.10.2018	EUR	14,01 %	10,27 %	13,94 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M)	05.06.2017	SGD	13,65 %	9,92 %	15,78 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	26.09.2017	USD	8,90 %	2,97 %	2,15 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	26.09.2017	USD	15,15 %	11,34 %	18,04 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	12.12.2016	USD	8,58 %	2,70 %	1,43 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	12.04.2021	USD	14,81 %	11,09 %	17,36 %	–
	Klasse E EUR Thesaurierend	06.04.2023	EUR	13,13 %	9,48 %	–	–
	Klasse E EUR Ausschüttend (A)	06.04.2023	EUR	13,17 %	9,63 %	–	–
	Klasse F USD Thesaurierend	10.08.2017	USD	9,98 %	4,10 %	5,51 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	26.09.2017	USD	16,50 %	12,73 %	22,28 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	20.03.2019	USD	10,33 %	4,33 %	6,35 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	17.05.2017	USD	10,42 %	4,40 %	6,53 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	24.10.2018	EUR	15,01 %	11,23 %	17,03 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	05.03.2021	EUR	12,21 %	7,67 %	9,73 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	30.05.2019	GBP	10,70 %	6,19 %	14,99 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	04.02.2014	USD	10,57 %	4,59 %	7,02 %	64,92 %
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	21,55 %	16,90 %	46,69 %	–
	Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	16.06.2017	CAD	13,16 %	8,76 %	14,41 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	11.05.2012	EUR	15,25 %	11,47 %	17,72 %	78,08 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	17.04.2019	EUR	12,55 %	7,89 %	10,09 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	30.06.2016	GBP	10,95 %	6,46 %	15,71 %	–
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	25.06.2009	GBP	14,14 %	9,44 %	14,44 %	69,58 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	26.04.2018	GBP	10,94 %	6,41 %	15,64 %	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	30.06.2023	EUR	15,49 %	11,75 %	–	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	16.06.2021	USD	10,22 %	0,61 %	-5,10 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	30.04.2021	USD	10,21 %	0,61 %	-5,09 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	30.04.2021	USD	10,21 %	0,61 %	-5,09 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M)	12.08.2021	AUD	8,71 %	-1,04 %	-10,72 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M)	01.10.2021	CNH	7,22 %	-2,41 %	-10,82 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	11.08.2022	EUR	14,86 %	7,27 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M)	11.08.2021	EUR	7,94 %	-1,49 %	-12,17 %	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M)	23.11.2021	GBP	9,54 %	-0,06 %	-8,57 %	–
	Klasse A HKD Ausschüttend (M)	01.07.2021	HKD	9,46 %	0,04 %	-5,50 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M)	16.06.2021	SGD	7,92 %	-1,59 %	-9,40 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (M)	30.04.2021	USD	11,06 %	1,38 %	-2,94 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M)	26.04.2022	EUR	8,78 %	-0,72 %	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	30.04.2021	EUR	8,85 %	-0,66 %	-10,24 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	12.01.2022	GBP	10,35 %	0,69 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	27.05.2022	USD	11,38 %	1,69 %	–	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	09.06.2021	USD	11,39 %	1,68 %	-1,95 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	24.06.2021	EUR	9,03 %	-0,42 %	-9,14 %	–
	Klasse S USD Thesaurierend	27.01.2023	USD	11,57 %	1,85 %	–	–
	Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	13.09.2023	USD	11,56 %	1,84 %	–	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	25.01.2023	EUR	16,27 %	8,56 %	–	–
	Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	11.12.2023	EUR	16,22 %	8,59 %	–	–
	Klasse S GBP Thesaurierend	26.01.2023	GBP	11,86 %	3,61 %	–	–
	Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	08.03.2023	GBP	10,75 %	1,13 %	–	–
	Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	23.08.2023	GBP	10,86 %	1,17 %	–	–
	Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	28.04.2023	GBP	11,97 %	3,69 %	–	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	17.06.2021	USD	11,78 %	2,04 %	-0,91 %	–
	Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	06.07.2021	USD	11,78 %	2,04 %	-0,91 %	–
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	17,16 %	14,61 %	–	–
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	SGD	15,32 %	13,08 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	18,37 %	15,78 %	–	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	18,78 %	16,19 %	–	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	EUR	16,55 %	14,11 %	–	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	GBP	17,95 %	15,47 %	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	3,34 %	9,43 %	6,43 %	117,93 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	08.11.2002	USD	3,34 %	9,43 %	6,43 %	117,92 %
	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	03.06.2013	AUD	1,80 %	7,53 %	-0,63 %	88,53 %
	Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	05.12.2016	CNH	0,78 %	6,42 %	0,12 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.07.2007	EUR	7,58 %	16,55 %	16,89 %	134,32 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	20.02.2013	EUR	1,52 %	7,49 %	-1,36 %	77,32 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	16.11.2016	EUR	1,50 %	7,43 %	-1,47 %	–
	Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	20.12.2013	GBP	2,71 %	8,74 %	2,16 %	87,35 %
	Klasse A GBP ausschüttend (A)	26.04.2011	GBP	3,67 %	11,40 %	15,03 %	167,64 %
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SEK	1,06 %	6,96 %	-2,39 %	67,04 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	16.02.2011	SGD	3,75 %	13,18 %	7,67 %	114,84 %
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	10.09.2012	SGD	1,35 %	7,26 %	1,59 %	98,47 %
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	2,82 %	8,88 %	4,85 %	107,29 %
	Klasse B USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	2,83 %	8,89 %	4,84 %	107,10 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	2,82 %	8,88 %	4,84 %	107,29 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	2,82 %	8,88 %	4,84 %	107,29 %
	Klasse E USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	2,57 %	8,61 %	4,06 %	102,17 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	2,57 %	8,61 %	4,06 %	102,17 %
	Klasse E EUR Thesaurierend	26.11.2010	EUR	6,83 %	15,73 %	14,35 %	117,77 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.09.2013	EUR	0,75 %	6,69 %	-3,49 %	64,40 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	3,97 %	10,09 %	8,36 %	131,41 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	3,96 %	10,09 %	8,36 %	131,40 %
	Klasse R EUR Thesaurierend	09.12.2013	EUR	8,21 %	17,21 %	18,74 %	147,58 %
	Klasse X USD Thesaurierend	25.02.2013	USD	4,12 %	10,25 %	8,84 %	134,91 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	28.11.2016	USD	4,12 %	10,25 %	8,85 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	11.10.2017	EUR	8,46 %	17,48 %	19,62 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.10.2013	EUR	2,23 %	8,31 %	0,85 %	90,73 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	18.01.2013	GBP	4,47 %	12,24 %	17,69 %	187,78 %
	Klasse X GBP ausschüttend (A)	23.04.2013	GBP	4,46 %	12,24 %	17,70 %	187,16 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	27.04.2010	USD	4,49 %	10,64 %	9,99 %	143,26 %
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	7,62 %	13,36 %	27,06 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	07.06.2010	EUR	8,85 %	17,89 %	20,85 %	161,52 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	31.08.2015	EUR	2,60 %	8,65 %	2,02 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	15.02.2013	GBP	4,83 %	12,63 %	18,90 %	197,74 %
	Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	03.08.2018	PLN	4,64 %	10,60 %	12,96 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.24-28.02.25	Kalenderjahr 01.01.24-31.12.24	3 Jahre kumulativ 01.01.22-31.12.24	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.15-28.02.25
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	-3,11 %	1,78 %	3,36 %	75,91 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	01.03.2004	USD	-3,14 %	1,74 %	3,26 %	75,58 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	01.10.2008	EUR	0,93 %	8,44 %	13,51 %	88,75 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	05.06.2013	EUR	-4,81 %	0,05 %	-4,21 %	43,11 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	09.02.2011	EUR	0,91 %	8,44 %	13,32 %	90,30 %
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SEK	-5,28 %	-0,45 %	-5,08 %	36,41 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	-3,59 %	1,28 %	1,83 %	67,30 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	01.03.2004	USD	-3,63 %	1,24 %	1,72 %	67,01 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	-3,87 %	0,98 %	0,96 %	62,89 %
	Klasse E EUR Thesaurierend	14.01.2019	EUR	0,05 %	7,51 %	10,81 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	-2,56 %	2,36 %	5,13 %	86,44 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.02.2010	USD	-2,56 %	2,36 %	5,13 %	86,45 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	15.04.2021	USD	-2,33 %	2,60 %	6,01 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.11.2009	USD	-2,08 %	2,87 %	6,72 %	95,94 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	18.02.2011	USD	-2,07 %	2,87 %	6,71 %	95,99 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	20.05.2011	GBP	-1,73 %	4,73 %	15,32 %	140,02 %
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	-2,56 %	2,36 %	5,13 %	86,44 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	-3,05 %	1,84 %	3,57 %	77,33 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	-2,46 %	-2,78 %	-19,07 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	-1,61 %	-1,96 %	-17,16 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	11.08.2022	GBP	-1,34 %	-0,26 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	-1,38 %	-1,71 %	-16,36 %	–
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	28.06.2016	USD	-6,14 %	3,03 %	-16,97 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	28.06.2016	EUR	-2,23 %	9,77 %	-8,76 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	24.03.2021	EUR	-8,04 %	1,03 %	-23,86 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	09.09.2021	USD	-6,63 %	2,49 %	-18,23 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	14.08.2019	USD	-6,84 %	2,26 %	-18,82 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	29.07.2021	USD	-5,56 %	3,65 %	-15,47 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	28.06.2016	EUR	-1,37 %	10,73 %	-6,57 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	28.06.2016	GBP	-4,96 %	5,81 %	-8,08 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	28.06.2016	GBP	-6,00 %	3,16 %	-19,05 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	28.06.2016	USD	-5,09 %	4,17 %	-14,19 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	05.03.2021	EUR	-6,72 %	2,48 %	-20,51 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend	28.06.2016	GBP	-4,55 %	6,30 %	-6,34 %	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	24.11.2017	USD	5,85 %	0,68 %	-23,42 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	10.09.2018	USD	5,06 %	-0,07 %	-25,13 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	13.11.2018	USD	6,49 %	1,29 %	-22,04 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	13.12.2017	USD	6,64 %	1,42 %	-21,75 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	13.12.2017	USD	7,02 %	1,79 %	-20,87 %	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	29.10.2018	USD	7,24 %	2,00 %	-20,38 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend	16.01.2018	EUR	11,74 %	8,70 %	-12,43 %	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Klasse A EUR Thesaurierend	09.11.2018	EUR	-6,22 %	-5,57 %	-26,44 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	09.11.2018	EUR	-5,51 %	-4,86 %	-24,77 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	09.11.2018	EUR	-5,18 %	-4,52 %	-23,97 %	–
	Klasse P1 USD Thesaurierend	12.05.2022	USD	-8,58 %	-9,98 %	–	–
	Klasse P1 EUR Thesaurierend	07.05.2019	EUR	-4,79 %	-4,13 %	-23,05 %	–
	Klasse P1 GBP Thesaurierend	19.11.2021	GBP	-8,32 %	-8,44 %	-24,35 %	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	20.06.2023	USD	7,74 %	1,08 %	–	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	20.10.2023	GBP	8,97 %	3,72 %	–	–
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	05.07.2023	GBP	7,90 %	1,21 %	–	–
	Klasse P1 USD Thesaurierend	20.06.2023	USD	9,78 %	2,98 %	–	–
	Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	20.06.2023	EUR	7,64 %	1,03 %	–	–
	Klasse P1 GBP Thesaurierend	20.10.2023	GBP	10,04 %	4,75 %	–	–
	Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	20.06.2023	GBP	9,07 %	2,32 %	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	Klasse A EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	5,70 %	4,18 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	5,70 %	4,19 %	–	–
	Klasse D EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	5,10 %	3,61 %	–	–
	Klasse D EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	5,12 %	3,62 %	–	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	6,11 %	4,60 %	–	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	6,12 %	4,60 %	–	–

In den Wertentwicklungsdaten sind die Gebühren und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025

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 Anteilsinhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe und -verkäufe einer Anlage (einschließlich Fälligkeiten, aber ohne Finanzderivate), die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe während des Geschäftsjahrs überschreiten. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und die zwanzig größten Verkäufe aufgeführt. Sollte ein Fonds während des Geschäftsjahrs weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt haben, sind alle Transaktionen aufgeführt.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,450 %, fällig 02.01.2025	163.006
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,450 %, fällig 02.01.2025	163.006	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,350 %, fällig 03.01.2025	158.589
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,350 %, fällig 03.01.2025	158.589	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,300 %, fällig 06.01.2025	147.201
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,360 %, fällig 03.03.2025	150.000	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,570 %, fällig 02.12.2024	140.860
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,300 %, fällig 06.01.2025	147.201	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 06.02.2025	140.000
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,570 %, fällig 02.12.2024	140.860	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,330 %, fällig 29.01.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,350 %, fällig 03.03.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 18.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 13.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 04.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 18.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 24.01.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 04.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 31.01.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 31.01.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 05.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 28.01.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,300 %, fällig 21.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 14.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,330 %, fällig 03.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 28.02.2025	140.000	JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 27.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 19.02.2025	140.000	JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 28.02.2025	140.000
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 27.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 12.02.2025	140.000
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,340 %, fällig 28.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 27.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 24.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 25.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 25.02.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 30.01.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,320 %, fällig 30.01.2025	140.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 26.02.2025	140.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 4,310 %, fällig 26.02.2025	140.000		

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	59.773
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	60.710	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	4.849
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.932	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	2.645
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	1.884	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	2.388
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	1.638	Freddie Mac Pool 'RA9639', 6,000 %, fällig 08.01.2053	1.997
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2029	1.535	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.932
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034	1.486	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	1.804
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.423	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	1.621
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.303	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2029	1.538
Ginnie Mae, 30 Jahre, 5,500 %, fällig 31.12.2049	1.285	Fannie Mae Pool 'BU1118', 2,500 %, fällig 01.10.2051	1.530
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	1.278	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.424
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.271	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	1.403
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	1.118	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.305
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.107	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	1.281
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.103	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.279
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.060	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	1.212
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	1.023	Fannie Mae Pool 'CB1301', 2,500 %, fällig 01.08.2051	1.203
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	909	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	1.166
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	899	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	1.162
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	804	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	1.141
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	801		

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	38.868
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	37.974	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.317
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	14.304	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	12.448
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.725	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	11.924
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.234	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.912
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.173	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.477
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.945	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	10.173
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.885	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.790
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.705	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.676
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	9.106		

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.578	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.633
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.055	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	9.528
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.958	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	8.519
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.463	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.306
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.363	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.046
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.106	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.994
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.542	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.285
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.519	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.257
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	6.267	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.954
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.027	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033	6.827
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.956	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.554

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4.900	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.685
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	1.006	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	3.675
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, fällig 15.02.2033	992	Niederländische Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 15.07.2030	2.175
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	901	Italien Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3,250 %, fällig 01.09.2046	2.120
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	469	Französische Republik, Staatsanleihe OAT, 3,250 %, fällig 25.05.2045	1.776
Staatsanleihe der französischen Republik OAT, 144A, 3,500 %, fällig 25.11.2033	437	Französische Republik, Staatsanleihe OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2030	1.760
Ginnie Mae II Pool 'MA9422', 5,000 %, fällig 20.01.2054	273	Republik Österreich, Staatsanleihe, 0,900 %, fällig 20.02.2032	1.158
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2029	148	Export-Import Bank of Korea, 0,375 %, fällig 26.03.2024	1.150
Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	107	Staatsanleihe des Königreichs Belgien, Serie 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045	1.049
Fannie Mae Pool 'CA7240', 2,500 %, fällig 01.10.2050	107	Europäischer Stabilitätsmechanismus, Serie EUR, 0,750 %, fällig 05.09.2028	1.037
Ginnie Mae II Pool 'MA6930', 2,000 %, fällig 20.10.2050	98	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	1.037
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	94	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,300 %, fällig 15.02.2033	1.010
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	94	Spanische Staatsanleihe, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	929
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	93	Italienische Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 10Y, 2,500 %, fällig 01.12.2032	832
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	93	Staatsanleihe der französischen Republik OAT, Serie OAT, 144A, 0,000 %, fällig 25.05.2032	814
Ginnie Mae II Pool 'MA9487', 5,000 %, fällig 20.02.2054	91	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.07.2033	714
Fannie Mae Pool 'CB5686', 5,000 %, fällig 02.01.2053	90	Internationale Anleihe der Republik Südafrika, 4,300 %, fällig 12.10.2028	705
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	89	Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025	692
Ginnie Mae II Pool 'MA9539', 4,500 %, fällig 20.03.2054	89	Deutsche Bundesrepublik Inflationsindexierte Anleihe, Serie WL, 0,500 %, fällig 15.04.2030	676
		Staatsanleihe der Republik Polen, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	668
		Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	642
		Logicor Financing Srl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	642
		BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028	637
		Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028	624
		Lloyds Banking Group Plc, 4,703 %, fällig 21.06.2024	610
		Internationale Staatsanleihe Mexiko, 2,875 %, fällig 08.04.2039	606

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	27.043	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	12.188
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	7.602	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 30.04.2024	6.225
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.09.2030	4.980	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	4.944
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	4.730	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2031	4.682
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	3.498	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	4.235
Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, fällig 01.02.2042	1.967	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.09.2030	2.905
Lloyds Banking Group Plc, 8,500 %, ohne Laufzeitbegrenzung	1.731	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	2.550
Ginnie Mae II Pool 'MA9851', 5,500 %, fällig 20.08.2054	1.598	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	2.419
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.597	Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, fällig 01.02.2042	2.028
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1585	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.982
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	1.255	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.769
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.228	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	1.713
Fannie Mae Pool 'MA4606', 2,000 %, fällig 05.01.2042	1.169	Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, ohne Laufzeitbegrenzung	1.707
Israel, Internationale Staatsanleihe, Series 5Y, 5,375 %, fällig 19.02.2030	1.150	Ginnie Mae II Pool 'MA9851', 5,500 %, fällig 20.08.2054	1.608
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.076	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.598
Air Lease Corp, 3,700 %, fällig 15.04.2030	1.003	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.598
Devon Energy Corp, 5,200 %, fällig 15.09.2034	1.000	QazaqGaz NC JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	1.474
Dufry One BV, 4,750 %, fällig 18.04.2031	944	Ägypten, Internationale Staatsanleihe, 3,875 %, fällig 16.02.2026	1.312
OCP SA, REGS, 6,750 %, fällig 02.05.2034	936	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	1.217
Pinewood Finco Plc, 6,000 %, fällig 27.03.2030	931	Fannie Mae Pool 'MA4606', 2,000 %, fällig 05.01.2042	1.209

FTGF Western Asset US High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	53.167	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	52.862
Mcclatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031	1.342	Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	1.401
EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	1.004	Barclays Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe	1.279
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	920	Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	891
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	898	Vericast Corp, 12,035 %, fällig 15.06.2030	859
Vericast Corp, 12,035 %, fällig 15.06.2030	892	Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	845

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	783
Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	782	Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	772
Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2032	720	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	756
United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	677	Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	753
Rent-A-Center Inc/TX, 7,041 %, fällig 17.02.2028	652	United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	746
Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	562	Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	742
Esab Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2029	559	Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2032	720
EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	539	Rent-A-Center Inc/TX, 7,041 %, fällig 17.02.2028	659
VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	535	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	638
APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	521	UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035	634
Ladder Capital Finance Holdings LLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2031	521	Boost Newco Borrower LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	623
Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2032	520	SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig 15.12.2028	601
Level 3 Financing Inc, 144A, 11,000 %, fällig 15.11.2029	518	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	600
Masterbrand Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2032	517	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	596
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	514		

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 08.01.2024	1.750
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 14.03.2024	1.000	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.228
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.03.2024	999	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 14.03.2024	1.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.08.2024	998	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.03.2024	1.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.01.2024	847	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.08.2024	1.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 11.05.2024	747	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	899
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	657	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.01.2024	850
EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	570	H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	782
NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	510	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 11.05.2024	750
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.04.2024	500	China Aoyuan Group Limited, 0,000 %, fällig 08.02.2025	700
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 25.04.2024	499	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	648
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.02.2024	498	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	643
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	450	American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.03.2025	548
Türkei, Internationale Staatsanleihe, Series 11Y, 4,250 %, fällig 14.04.2026	384	Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029	512
Service Properties Trust, 8,875 %, fällig 15.06.2032	331	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.02.2024	500
EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	324	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 25.04.2024	500
EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	319	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.04.2024	500
Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	309	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.05.2024	500
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	300	Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.05.2025	500
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 25.07.2024	300	Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	487
		APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	485
		Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	484
		Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	483
		Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	472
		Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	462
		Internationale Anleihe der ukrainischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	457
		Telecom Italia SpA.Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	430
		Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	422
		Türk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28.02.2025	415
		CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	412
		Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 7,050 %, fällig 03.02.2031	412

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	82.435
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	82.399	Malaysische Staatsanleihe, Serie 0318, 4,642 %, fällig 07.11.2033	10.909
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 30.11.2024	9.317	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 30.11.2024	9.406
Malaysia, Staatsanleihe, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	8.748	QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23.01.2025	8.600
Singapur, Staatsanleihe, 3,000 %, fällig 01.08.2072	5.285	Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	7.895
Thailändische Staatsanleihe, 2,050 %, fällig 17.04.2028	4.895	Korea, Schatzanleihe, Series 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	6.625
Staatsanleihe Singapur, 1,875 %, fällig 01.10.2051	4.102	Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig 15.08.2024	6.371
Thailändische Staatsanleihe, 2,800 %, fällig 17.06.2034	3.559	Vietnam, Internationale Staatsanleihe, 4,800 %, fällig 19.11.2024	4.493
Korea, Schatzanleihe, Series 5403, 3,250 %, fällig 10.03.2054	2.961	Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	4.375
International Finance Corp, 6,300 %, fällig 25.11.2024	1.791	National Environment Agency, 2,500 %, fällig 15.09.2051	4.359
Banco Santander SA, 3,600 %, fällig 23.10.2030	1.713	Australia Staatsanleihe, 3,750 %, fällig 21.04.2037	4.344
Malaysia, Staatsanleihe, Series 0220, 2,632 %, fällig 15.04.2031	1.286	Korea, Schatzanleihe, Series 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	4.280
Korea Housing Finance Corp, 5,125 %, fällig 21.01.2030	1.262	Staatsanleihe Singapur, 1,875 %, fällig 01.10.2051	4.099
Korea Development Bank/The, 4,875 %, fällig 03.02.2030	1.256	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15.05.2027	3.935
Airport Authority, 4,875 %, fällig 15.07.2030	1.253	REC Ltd, 2,250 %, fällig 01.09.2026	3.807
Korea National Oil Corp, 4,250 %, fällig 30.09.2029	1.214	Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	3.559
Petronas Capital Ltd, 3,500 %, fällig 21.04.2030	1.162	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	3.357
Indische Staatsanleihe, 7,300 %, fällig 19.06.2053	611	Singapur, Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	3.184
		Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02.12.2024	3.145
		International Finance Corp, 6,300 %, fällig 25.11.2024	2.966
		Thailändische Staatsanleihe, 2,800 %, fällig 17.06.2034	2.788
		Chinesische Staatsanleihe, Serie INBK, 3,120 %, fällig 25.10.2052	2.476
		Indische Staatsanleihe, Serie SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	2.373

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	189.673
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	193.009	Caterpillar Financial Services Corp, 5,050 %, fällig 27.02.2026	7.227
GAS Networks Ireland, 3,250 %, fällig 12.09.2030	5.239	Credit Agricole SA/London, 1,907 %, fällig 16.06.2026	6.258
Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,450 %, fällig 22.09.2031	4.964	Novartis Finance SA, 0,000 %, fällig 23.09.2028	5.638
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	4.480	Union Pacific Corp, 4,750 %, fällig 21.02.2026	5.310
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, EMTN, 2,750 %, fällig 07.11.2027	4.452	Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig 15.02.2027	5.288
Swisscom Finance BV, EMTN, 3,500 %, fällig 29.08.2028	3.871	Inter-American Development Bank, 0,500 %, fällig 15.09.2026	5.139
Credit Agricole SA, 3,125 %, fällig 26.02.2032	3.633	NatWest Markets Plc, 1,375 %, fällig 02.03.2027	4.945
Wolters Kluwer NV, 3,250 %, fällig 18.03.2029	3.495	GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, fällig 12.09.2029	4.850
Coventry Building Society, 3,125 %, fällig 29.10.2029	3.369	Nederlandse Waterschapsbank NV, 4,500 %, fällig 18.06.2025	4.811
National Australia Bank Ltd, Series emtN, 3,125 %, fällig 28.02.2030	3.342	Sanofi SA, 1,250 %, fällig 06.04.2029	4.770
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, EMTN, 3,125 %, fällig 16.05.2031	3.209	Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033	4.756
Coöperatieve Rabobank UA, 4,875 %, fällig 17.04.2029	3.128	Coca-Cola Co/The, 0,125 %, fällig 15.03.2029	4.712
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	3.029	ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	4.501
UnitedHealth Group Inc, 4,700 %, fällig 15.04.2029	2.913	Deutsche Börse AG, 3,750 %, fällig 28.09.2029	4.489
Novo Nordisk Finance Netherlands BV, EMTN, 3,125 %, fällig 21.01.2029	2.816	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	4.469
Bundesobligation, 0,000 %, fällig 16.04.2027	2.709	Svensk Exportkredit AB, 4,500 %, fällig 11.03.2026	4.459
Nestle Capital Corp, 144A, 4,650 %, fällig 12.03.2029	2.396	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, EMTN, 2,750 %, fällig 07.11.2027	4.269
Hyundai Capital America, 144A, 5,400 %, fällig 24.06.2031	2.368	Bank of New York Mellon Corp/The, 4,947 %, fällig 26.04.2027	4.265
Athene Global Funding, 3,410 %, fällig 25.02.2030	2.342	JPMorgan Chase & Co, 1,045 %, fällig 19.11.2026	4.226
Illinois Tool Works Inc, 3,250 %, fällig 17.05.2028	2.262		

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 15.04.2024	11.549
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.08.2028	3.824	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	5.207
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	3.216	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.08.2028	3.984
Australische Staatsanleihe, Serie 167, 3,750 %, fällig 21.05.2034	3.066	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3.344
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.03.2026	2.752	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	3.306
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 31.05.2029	2.476	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.07.2033	2.980
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.04.2029	2.426	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	2.860
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.383	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.03.2026	2.775
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.362	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.04.2029	2.387
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.320	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.384
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.280	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.379
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.272	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.296
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.207	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.277
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 20.02.2025	2.198	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 20.02.2025	2.240
Japanische 2-jährige Staatsanleihe, Serie 462, 0,400 %, fällig 01.07.2026	2.033	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.232
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.028	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.079
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.990	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.993
Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Serie 170, 0,600 %, fällig 20.06.2029	1.923	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.949
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.897	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2033	1.854
Japanische 10-jährige Staatsanleihe, Serie 375, 1,100 %, fällig 20.06.2034	1.886	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	1.738
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.831		
Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Serie 169, 0,500 %, fällig 20.03.2029	1.767		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.647		
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.627		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.605		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.599		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.593		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.572		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.543		

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.612
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	10.935	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.05.2035	510
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032	486	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	418
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.05.2035	483	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	407
Lloyds Banking Group Plc, 3,625 %, fällig 04.03.2036	426	UniCredit SpA, 2,000 %, fällig 23.09.2029	366
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	407	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2033	307
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	400	GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18.07.2029	296
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2033	308	Standard Chartered Plc, 2,500 %, fällig 09.09.2030	280
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	285	Barclays Plc, 6,375 %, Ewige Anleihe	259
UBS Group AG, 3,250 %, fällig 12.02.2034	269	Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	252
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	235	BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, fällig 09.01.2030	241
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2026	219	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	240
Finnair Oyj, 4,750 %, fällig 24.05.2029	217	UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	226
Intesa Sanpaolo SpA, 7,000 %, fortwährend	216	Bouygues SA, 3,875 %, fällig 17.07.2031	220
Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, EMTN, 3,375 %, fällig 16.05.2036	215	CTP NV, Series emTN, 4,750 %, fällig 05.02.2030	219
Banco Santander SA, 3,500 %, fällig 17.02.2035	208	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2026	219
Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	207	UBS Group AG, 4,125 %, fällig 09.06.2033	215
Generali, EMTN, 4,083 %, fällig 16.07.2035	207	Cie Generale des Etablissements Michelin SCA, EMTN, 3,375 %, fällig 16.05.2036	214
BNP Paribas SA, 4,199 %, fällig 16.07.2035	206	Finnair Oyj, 4,750 %, fällig 24.05.2029	214
Vesteda Finance BV, EMTN, 4,000 %, fällig 07.05.2032	203	Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15.12.2031	213
Bank of Montreal, 7,300 %, fällig 26.11.2084	202		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	496.974
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	457.190	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	76.146
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.06.2031	77.409	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 26.09.2024	74.914
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2031	76.797	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.07.2031	74.692
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 26.09.2024	74.696	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.10.2024	65.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.10.2024	64.816	Staatsanleihe der Republik Polen, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	59.185
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	52.605	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	53.357
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 09.12.2024	49.898	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	51.066
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.10.2024	49.700	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 09.12.2024	50.000
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	39.588	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.10.2024	49.880
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.10.2024	34.865	Staatsanleihe Republik Südafrika, Serie 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	43.309
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.09.2024	29.939	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.192
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.01.2024	29.879	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.10.2024	35.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.09.2024	24.924	Indische Staatsanleihe, 6,190 %, fällig 16.09.2034	32.753
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.10.2024	24.911	Indonesische Schatzanleihe, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	31.955
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	22.163	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.09.2024	30.000
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	18.006	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.01.2024	30.000
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	13.727	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	28.359
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	13.596	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.10.2024	25.000
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	13.066	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.09.2024	25.000
Ginnie Mae II Pool 'MA8947', 5,000 %, fällig 20.06.2053	12.793		

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2026	9.151
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2026	9.150	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.11.2034	3.461
Mclatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031	6.305	Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	3.043
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	3766	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	2.822
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.11.2034	3.466	Mexikanische Bonos, Serie M, 8,500 %, fällig 31.05.2029	2.762
Fannie Mae Pool 'FA0024', 2,000 %, fällig 08.01.2042	2.295	American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026	2.694
CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	2030	MPLX LP, Serie A	2.606
CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	1.938	CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	2.372
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.874	United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 31.10.2025	2.082
Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	1.849	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	1.824
Fannie Mae Pool 'FS2463', 3,000 %, fällig 01.02.2052	1.706	Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024	1.770
Freddie Mac Pool 'QG1295', 5,500 %, fällig 01.04.2053	1.668	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.726
NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	1.650	Cinemark USA Inc, 9,098 %, fällig 24.05.2030	1.719
Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class DRR, 144A, 7,390 %, fällig 23.10.2034	1.430	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2027	1.683
CoreCivic Inc, 4,750 %, fällig 15.10.2027	1.417	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	1.650
EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	1.400	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025	1.629
MF1 2024-FL16, Series 2024 FL16, Class A, 144A, 5,853 %, fällig 18.11.2039	1.377	SilverBow Resources Inc, 144A, 13,135 %, fällig 15.12.2028	1.588
Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	1.323	Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	1.531
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe	1.314	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.466
Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	1.313	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.465
Nexus Buyer LLC, 8,312 %, fällig 18.07.2031	1.266		

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	212.572
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	196.602	Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,968 %, fällig 27.09.2024	12.260
Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 5,652 %, fällig 25.12.2054	20.000	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Serie 2018 SB48, Klasse B, 144A, 4,748 %, fällig 25.02.2038	10.023
Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,652 %, fällig 25.12.2054	20.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Serie 2019 R07, Klasse B1, 144A, 7,866 %, fällig 25.10.2039	7.527
Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B2, 144A, 10,352 %, fällig 25.10.2041	6.035	BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 11,245 %, fällig 15.07.2025	5.312
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B2, 144A, 12,852 %, fällig 25.02.2042	5.534	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI3, Series 2018 SPI3, Class B, 144A, 4,150 %, fällig 25.08.2048	5.117
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2025-DNA1, Series 2025 DNA1, Class M2, 144A, 5,702 %, fällig 25.01.2045	5.500	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class B1, 144A, 9,563 %, fällig 25.07.2039	4.937
BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Series 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041	3.980	Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-DNA2, Series 2017 DNA2, Class B2, 16,713 %, fällig 25.10.2029	4.633
CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,794 %, fällig 15.07.2032	3.961	Magnolia Finance, 8,552 %, fällig 09.08.2024	4.598
AGNC Investment Corp, Series F	3.947	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 17,686 %, fällig 25.09.2028	4.265
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4, Series 2021 HQA4, Class B2, 144A, 11,352 %, fällig 25.12.2041	3.871	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI2, Series 2018 SPI2, Class B, 144A, 3,844 %, fällig 25.05.2048	4.194
OBX 2024-NQM15 Trust, Series 2024 NQM15, Class A3, 144A, 5,722 %, fällig 25.10.2064	3760	Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, 6,215 %, fällig 25.12.2035	4.105
Horizon Aircraft Finance III Ltd, Series 2019 2, Class A, 144A, 3,425 %, fällig 15.11.2039	3.225	CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Class 7A2, 144A, 4,463 %, fällig 27.08.2036	3.713
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1B2, 144A, 10,352 %, fällig 25.12.2041	3.173	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B2, 144A, 2,977 %, fällig 25.07.2057	3.488
Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class E, 144A, 4,489 %, fällig 15.02.2050	3.153	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 17,186 %, fällig 25.10.2028	3.405
SMB Private Education Loan Trust 2022-A, Series 2022 A, Class D, 144A, 4,750 %, fällig 16.11.2054	3.131	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B2, 144A, 3,797 %, fällig 25.03.2058	3.369
Chimera Investment Corp, Serie C	3.117	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B1, 144A, 2,977 %, fällig 25.07.2057	3.324
Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class E, 144A, 4,374 %, fällig 15.09.2048	3.048	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class BIO, 144A, 1,645 %, fällig 25.06.2057	3.284
BWAY 2013-1515 Mortgage Trust, Series 2013 1515, Class F, 144A, 3,927 %, fällig 10.03.2033	2.971	CSMC 2014-USA OA LLC, 4,373 %, fällig 15.09.2037	3.280
HOMES 2025-NQM1 Trust, Series 2025 NQM1, Class A3, 144A, 5,961 %, fällig 25.01.2070	2.950	Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 5,832 %, fällig 25.09.2036	3.153
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02, Series 2022 R02, Class B2, 144A, 12,002 %, fällig 25.01.2042	2.755		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

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

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	333.620
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	394.013	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	65.492
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	65.488	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	65.261
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	65.209	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	55.106
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	55.049	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	52.254
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	52.238	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	50.634
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	50.630	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	49.727
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	49.525	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.790
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.799	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	38.012
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.845	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.743
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	36.087	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	33.417
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.520	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.279
Ginnie Mae, 30 Jahre, 5,500 %, fällig 31.12.2049	33.497	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	28.202
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.333	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.371
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	28.202	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	26.709
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.847	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.657
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 6,500 %	27.413	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 6,000 %	25.116
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	26.776	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.715
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	26.724	Ginnie Mae II Pool 'MA7051', 2,000 %, fällig 20.12.2050	23.518
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.498	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	23.153
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.730		

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

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.620
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	5.132	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	1.021
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	1.408	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	528
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	194	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033	241
Ginnie Mae, 30 Jahre, 5,000 %, fällig 31.12.2049	194	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2030	241
Ginnie Mae II Pool 'MB0146', 5,000 %, fällig 20.01.2055	194	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	194
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	193	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	194
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	180	Ginnie Mae II Pool 'MA9851', 5,000 %, fällig 20.01.2055	193
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	136	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	193
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	127
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	99	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.07.2030	119
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	99	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2015 C03, Klasse 1M2, 10,436 %, fällig 25.07.2025	112
Ginnie Mae II Pool 'MA9422', 5,000 %, fällig 20.01.2054	98	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Serie 2022 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,972 %, fällig 25.04.2042	108
Ginnie Mae II Pool 'MA9850', 5,000 %, fällig 20.08.2054	98	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	108
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100
Ginnie Mae II Pool 'MA9540', 5,000 %, fällig 20.03.2054	97	Ginnie Mae II Pool 'MA9851', 5,000 %, fällig 20.08.2054	99
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	99
Ginnie Mae II Pool 'MB0091', 5,000 %, fällig 20.12.2054	97	Ginnie Mae II Pool 'MA9851', 5,000 %, fällig 20.03.2054	98
Ginnie Mae II Pool 'MA9667', 5,000 %, fällig 20.05.2054	96	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98
United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	80	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.11.2025	70	Ginnie Mae II Pool 'MB0091', 5,000 %, fällig 20.12.2054	97
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97
		Ginnie Mae II Pool 'MA9667', 5,000 %, fällig 20.05.2054	97
		Ginnie Mae II Pool 'MA9422', 5,000 %, fällig 20.01.2054	96

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	64.337
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	63.108	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	40.855
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	41.613	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	30.365
United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 31.10.2028	25.506	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 31.10.2028	26.178
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	23.639	United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	15.406
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	12.019	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	11.565
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	11.116	United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	9.520
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	9.360	Norwegen, Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 13.03.2025	9.226
United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	9.287	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	9.198
Norwegen, Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 13.03.2025	9.229	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.02.2034	8.463
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.02.2034	8.057	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	8.145
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	7.994	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 5,125 %, fällig 29.09.2025	7.823
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 31.07.2034	7.257	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2025	7.355
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	6.209	International Bank for Reconstruction & Development, 2,500 %, fällig 25.11.2024	7.197
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	5.503	Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 17.04.2024	7.017
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 18.09.2024	3.916	Australien, Staatsanleihe, Series 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	6.887
Australien, Staatsanleihe, 0,250 %, fällig 21.11.2024	3.860	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	6.885
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 5,125 %, fällig 29.09.2025	3.581	United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	6.461
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	3.408	Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	5.785
Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	1.724	Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	5.701
Australische Staatsanleihe, Serie 170, 4,250 %, fällig 21.06.2034	1.272	Mexikanische Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig 24.05.2035	5.463
		Chile, internationale Staatsanleihe, 4,950 %, fällig 05.01.2036	4.606

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	4.293
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 18.09.2024	3.984
Australien, Staatsanleihe, 0,250 %, fällig 21.11.2024	3.981
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.854
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	3.495

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	76.465
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	45.245
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	41.967
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	19.854
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	17.679
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	12.104
United States Treasury Floating Rate Note, 4,485 %, fällig 31.01.2026	7.004
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2033	6.074
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	5.779
Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	5.700
Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	5.568
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN, 10,000 %, fällig 01.01.2035	4.868
Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	4.748
Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	4.741
Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	4.658
Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	4.384
Republik Polen, Staatsanleihe, Series CPI, 2,000 %, fällig 25.08.2036	4.371
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.04.2025	4.353
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.07.2025	4.347
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	4.193
Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	4.094

WICHTIGSTE VERKÄUFE

ERLÖSE (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	80.453
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	52.819
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	40.885
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	35.128
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig 30.04.2025	25.489
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	18.383
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	12.098
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	6.233
United States Treasury Floating Rate Note, 4,485 %, fällig 31.01.2026	5.259
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig 20.05.2053	4.616
Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig 20.09.2053	4.368
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	3.934
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	3.668
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig 01.12.2052	3.610
Neuseeland, Staatsanleihe, Series 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	3.560
Freddie Mac Pool 'SD8463', 6,000 %, fällig 09.01.2054	3.297
Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	2.728
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig 09.01.2052	2.712
Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig 20.04.2053	2.555
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 12.01.2052	2451

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	33.412
Sabre GBL Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2027	1.245
Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	1.168
New Fortress Energy Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.03.2029	1.054
Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	864
Mativ Holdings Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2029	825
Sabre GBL Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2027	785
NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	751
WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2025	732
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	712
XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	694
Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,000 %, fällig 15.01.2027	686
Saturn Oil & Gas Inc, 144A, 9,625 %, fällig 15.06.2029	668
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	660
Concentrix Corp, 6,850 %, fällig 02.08.2033	648
ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	647
Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	643
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	640
Adams Homes Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.10.2028	623
eG Global Finance Plc, 11,000 %, fällig 30.11.2028	618

WICHTIGSTE VERKÄUFE

ERLÖSE (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	31.136
Sabre GBL Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2027	1.524
Valvoline Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.02.2030	1.122
Walgreens Boots Alliance Inc, 3,800 %, fällig 18.11.2024	1.114
New Fortress Energy Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.03.2029	1.058
Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	851
NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	845
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	839
Sabre GBL Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2027	826
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	783
WESCO Distribution Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.06.2025	731
Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047	727
IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	721
Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	714
Vector Group Ltd, 144A, 10,500 %, fällig 01.11.2026	702
Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	699
XHR LP, 144A, 6,375 %, fällig 15.08.2025	694
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig 15.08.2027	650
eG Global Finance Plc, 144A, 12,000 %, fällig 30.11.2028	627
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	623

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	125.296
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	58.379
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	28.635
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	25.172
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	22.328
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.02.2034	18.028
Norwegen, Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 13.03.2025	17.960
Australische Staatsanleihe, Serie 142, 4,250 %, fällig 21.04.2026	16.892
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	16.602
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 15.01.2025	16.391
Australien, Staatsanleihe, 0,250 %, fällig 21.11.2024	15.918
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 18.09.2024	15.803
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	11.990
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	11.693
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	10.539
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 16.04.2025	8.795

WICHTIGSTE VERKÄUFE

ERLÖSE (in Tsd.) \$	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	123.313
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	52.854
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	35.625
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	29.301
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.02.2034	18.248
Norwegen, Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 13.03.2025	17.885
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 18.09.2024	16.438
Australien, Staatsanleihe, 0,250 %, fällig 21.11.2024	16.022
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 15.01.2025	15.429
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	12.589
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 17.04.2024	12.385
Australien, Staatsanleihe, Series 137, 2,750 %, fällig 21.04.2024	12.249
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	11.961
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	11.688
United Kingdom Gilt, 3,250 %, fällig 31.01.2033	11.409
Norwegische Staatsanleihe, Serie 476, 144A, 3,000 %, fällig 14.03.2024	10.001

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	7.692	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	9.264
Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	7.493	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	8.997
Kanada, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 07.05.2025	5.331	Ginnie Mae II Pool „MA8348“, 5,000 %, fällig 20.10.2052	8.831
Fannie Mae Pool 'MA5445', 6,000 %, fällig 08.01.2054	5.046	Australische Staatsanleihe, Serie 142, 4,250 %, fällig 21.04.2026	7.646
		Kolumbianische TES, Serie B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	6.843
		Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	6.480
		United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	6.163
		United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	5.822

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	700.736	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	690.235
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	40.111	United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	84.314
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 06.05.2025	23.075	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	43.396
NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	21.844	International Bank for Reconstruction & Development, 4,625 %, fällig 01.08.2028	39.902
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 04.02.2025	21.084	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,375 %, fällig 18.07.2025	39.246
Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	19.720	Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,900 %, fällig 31.10.2052	39.040
Mexiko, Bonos, Series M, 8,500 %, fällig 01.03.2029	18.969	International Bank for Reconstruction & Development, 0,500 %, fällig 28.10.2025	36.020
Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe	14.981	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	27.806
EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	14.012	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	25.421
EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	13.795	Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 04.02.2025	22.119
Panama, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 19.01.2063	12.826	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig 20.04.2053	20.070
Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	12.598	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	19.889
Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	12.383	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	19.080
Panama, Internationale Staatsanleihe, 3,870 %, fällig 23.07.2060	12.163	Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	18.001
Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	11.263	KeyBank NA.Cleveland OH, Serie BKNt, 5,674 %, fällig 14.06.2024	13.470
Argentinische Republik, Internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 09.07.2030	9.692	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	13.006
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	9178	Venture Global LNG Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.06.2028	12.779
Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2032	8816	Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	12.251
Walgreens Boots Alliance Inc, 8,125 %, fällig 15.08.2029	8.561	Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	10.965
Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	8270	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	10.808

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.054	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	10.000
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	1.800	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	2.041
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02, 144A, FRN, 9,835 %, fällig 25.01.2042	925	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Series 2020 DNA4, Class B1, 144A, 11,436 %, fällig 25.08.2050	1.115
Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R05, Series 2024 R05, Class 2B1, 144A, 6,352 %, fällig 25.07.2044	606	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA1, Series 2023 DNA1, Class B1, 144A, 13,472 %, fällig 25.03.2043	1.003
Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA3, Series 2019 HQA3, Class M2, 144A, 6,315 %, fällig 25.09.2049	496	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02, 144A FRN, 9,835 %, fällig 25.01.2042	925
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 8,352 %, fällig 25.11.2050	472	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Serie 2020 DNA3, Klasse B1, 144A, 10,536 %, fällig 25.06.2050	923
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-HQA1, 144A, FRN, 0,000 %, fällig 25.03.2044	450	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2B1, 144A, 9,716 %, fällig 25.06.2039	667
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 17.12.2024	295	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R02, Series 2020 R02, Class 2B1, 144A, 8,436 %, fällig 25.01.2040	654
Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 10,352 %, fällig 25.10.2033	272	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 8,566 %, fällig 25.07.2039	568
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.03.2025	245	Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA3, Series 2019 HQA3, Class M2, 144A, 6,315 %, fällig 25.09.2049	497
Freddie Mac REMICS FRN, 2,523 %, fällig 25.05.2054	242	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 8,352 %, fällig 25.11.2050	468
NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	220	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2024-HQA1, 144A FRN, 0,000 %, fällig 25.03.2044	451
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	209	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig 26.05.2033	404
PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	207	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	384
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	206	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class B1, 144A, 8,972 %, fällig 25.11.2041	344
Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	201	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	340
Navoi Mining & Metallurgical Combinat, 144A, 6,950 %, fällig 17.10.2031	200	Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 17.12.2024	331
Aston Martin Capital Holdings Ltd, 144A, 10,000 %, fällig 31.03.2029	200	Freedom Mortgage Corp, 7,625 %, fällig 01.05.2026	312
Fideicomiso Irrevocable de Administracion y Fuente de Pago Numero CIB/4323, 144A, 11,000 %, fällig 12.09.2030	200	Westjet Airlines, 7,579 %, fällig 31.01.2031	309
FIEMEX Energia – Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple, 144A, 7,250 %, fällig 31.01.2041	200	Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	293

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig 31.01.2025	22.053
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	19.485	United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	19.479
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	18.177	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	18.164
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig 31.01.2025	14.972	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.700
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.700	Mexiko, Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	7.005
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig 30.04.2025	4.133	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	4.506
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 17.12.2024	1.484	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2029	4.429
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.03.2025	1.071	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	4.205
Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig 20.05.2053	381	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig 30.04.2025	4.132
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	77	Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – LM Class US\$ Accumulating	4.023
		Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	3355
		Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	3.340
		Kolumbianische TES, Serie B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	2.453
		Petroleos Mexicanos, 6,950 %, fällig 28.01.2060	2.251
		Mexiko, Bonos, Series M, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.800
		Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	1.773
		Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.730
		Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 17.12.2024	1.575
		Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig 20.04.2053	1.532
		Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,128 %, fällig 14.03.2025	1.475
		Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig 20.05.2053	1.454
		Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.432
		General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	1421

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig 31.01.2025	4.661
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.937	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4.516
United States Treasury Floating Rate Note, 4,485 %, fällig 31.01.2026	1.952	United States Treasury Floating Rate Note, 4,485 %, fällig 31.01.2026	1.952
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig 30.04.2025	1.951	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 5,418 %, fällig 30.04.2025	1.951
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	1.951	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	1.951
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	1.951	United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	1.950
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	1.950	United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	1.950
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,931 %, fällig 31.01.2025	1520	United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	1.213
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	985	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	1.036
Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,000 %, fällig 30.07.2042	481	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M2, 144A, 7,122 %, fällig 25.11.2041	606
United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 31.07.2053	397	Kolumbianische TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	591
Australische Staatsanleihe, Serie 170, 4,250 %, fällig 21.06.2034	318	Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,000 %, fällig 30.07.2042	490
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	316	Spanische Staatsanleihe, 144A, 1,900 %, fällig 31.10.2052	479
NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	242	Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	448
Zorlu Enerji Elektrik Uretim AS, 144A, 11,000 %, fällig 23.04.2030	200	Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig 26.05.2033	446
LD Celulose Internacional GmbH, 144A, 7,950 %, fällig 26.01.2032	199	Mexiko, Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	389
Caja de Compensacion de Asignacion Familiar de Los Andes, 144A, 7,000 %, fällig 30.07.2029	199	United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 31.07.2053	366
Brasilien, Internationale Staatsanleihe, 6,125 %, fällig 22.01.2032	198	Australische Staatsanleihe, Serie 170, 4,250 %, fällig 21.06.2034	305
Svenska Handelsbanken AB, EMTN, 0,010 %, fällig 02.12.2027	166	Kolumbianische TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	273
Ziggo Bond Co BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.11.2032	166	NFE Financing LLC, 144A, 12,000 %, fällig 15.11.2029	260
Lumentum Holdings Inc, 0,500 %, fällig 15.06.2028	164		

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	14.832
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	14.534	United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	8.851
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	10.984	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 29.02.2028	8.601
United States Treasury Floating Rate Note, 4,410 %, fällig 31.10.2025	8.560	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	7.452
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	8.310	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 31.10.2028	4.858
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	6.706	United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	4746
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	6.272	United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	4.503
United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	4.747	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	3.419
United States Treasury Floating Rate Note, 4,390 %, fällig 30.04.2026	4.500	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	1.760
Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	1.620	Ginnie Mae II Pool 'MA8879', 5,500 %, fällig 20.05.2053	1.713
Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	1.572	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	1.704
Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	1.519	Ginnie Mae II Pool 'MA9171', 5,500 %, fällig 20.09.2053	1.582
Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig 20.11.2053	1.263	Ginnie Mae II Pool 'MA9241', 5,500 %, fällig 20.10.2053	1.578
Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	1.261	Ginnie Mae II Pool 'MA9362', 5,500 %, fällig 20.12.2053	1.415
Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	1.086	Fannie Mae Pool 'MA4806', 5,000 %, fällig 11.01.2052	1.310
Fannie Mae Pool 'MA4626', 4,000 %, fällig 06.01.2052	1.081	Ginnie Mae II Pool 'MA8801', 5,500 %, fällig 20.04.2053	1.141
Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	1.074	Fannie Mae Pool 'MA4626', 4,000 %, fällig 06.01.2052	1.137
Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.074	Fannie Mae Pool 'MA4783', 4,000 %, fällig 10.01.2052	1.128
Fannie Mae Pool 'MA4783', 4,000 %, fällig 10.01.2052	1.071	Fannie Mae Pool „MA4733“, 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.118
Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	1.029	Ginnie Mae II Pool 'MA9305', 5,500 %, fällig 20.11.2053	1.105
Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	1.000	Fannie Mae Pool 'MA5498', 6,000 %, fällig 10.01.2054	888
Fannie Mae Pool 'MA5498', 6,000 %, fällig 10.01.2054	887		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Value Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
UnitedHealth Group Inc	40.920	Vistra Corp	65.107
Nestle SA ADR	31.911	Constellation Energy Corp	45.139
PayPal Holdings Inc	24.567	Apollo Global Management Inc	40.536
Abbott Laboratories	23.669	Goldman Sachs Group Inc/The	38.292
Seagate Technology Holdings Plc	23.073	GE Vernova Inc	37.109
Schlumberger NV	22.004	Baker Hughes Co 'A'	29.825
Novo Nordisk A.S ADR	21.818	Meta Platforms Inc 'A'	29.256
PG&E Corp	19.777	Marvell Technology Inc	29.017
Charles Schwab Corp/The	19.701	United Parcel Service Inc 'B'	28.409
GXO Logistics Inc	19.163	Micron Technology Inc	27.058
Plains GP Holdings LP, MLP 'A'	19.028	Fiserv Inc	26.681
CVS Health Corp	18.766	Oracle Corp	26.069
Fairfax Financial Holdings Ltd	18.483	Union Pacific Corp	24.706
Skyworks Solutions Inc	18.424	TotalEnergies SE ADR	24.047
Global Payments Inc	18.065	Abbott Laboratories	23.335
GE Vernova Inc	17.626	Everest Group Ltd	23.312
Medtronic Plc	17.175	Kellanova	21.726
Talen Energy Corp	17.171	American International Group Inc	21.342
Venture Global Inc	16.044	Capital One Financial Corp	21.101
Corteva Inc	15.369	AES Corp/The	20.733
Johnson Controls International plc	14.804	Microsoft Corp	20.226
WESCO International Inc	14.761	Freeport-McMoRan Inc	19.538
WillScot Holdings Corp	14.663	Flowserv Corp	19.470
T-Mobile US Inc	14.563	NextEra Energy Inc	18.081
Fortune Brands Innovations Inc	14.417	First Horizon Corp	18.074
Murphy USA Inc	14.271	Tapestry Inc	17.882
Micron Technology Inc	13.823	Johnson & Johnson	17.315
Lamb Weston Holdings Inc	13.560	EQT Corp	17.226
Genuine Parts Co	12.907	Expedia Group Inc	16.733
Ryan Specialty Holdings Inc 'A'	12.841	Eastman Chemical Co	16.128
Teck Resources Ltd	12.745	CVS Health Corp	14.988
Gilead Sciences Inc	12.735	Bank of America Corp	14.968
Constellation Energy Corp	12.671	Biogen Inc	14.737
Jones Lang LaSalle Inc	12.646	PPL Corp	14.589
EQT Corp	12.505	Las Vegas Sands Corp	14.387
Microchip Technology Inc	12.306	Lamb Weston Holdings Inc	14.005
DraftKings Inc	11.952	Gilead Sciences Inc	13.063
M&T Bank Corp	11.661	United Utilities Group Plc	13.053
UCB SA	11.054	Block Inc	13.027
American International Group Inc	11.014	PayPal Holdings Inc	12.206
Corebridge Financial Inc	10.570	Enbridge Inc	12.073
American Homes 4 Rent 'A'	10.369		
AES Corp/The	10.274		

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Broadcom Inc	3.528	Microsoft Corp	5.259
Walt Disney Co/The	2.428	Merck & Co Inc	3.756
Synopsys Inc	2.260	Adobe Inc	3.533
Meta Platforms Inc 'A'	2.119	NVIDIA Corp	3.532
ICON Plc	1.969	Apple Inc	3.360
WEC Energy Group Inc	1.920	Berkshire Hathaway Inc	3.302
ConocoPhillips	1.672	United Parcel Service Inc 'B'	2.820
Bank of America Corp	1.402	Amazon.com Inc	2.728
Amazon.com Inc	1.395	Oracle Corp	2.492
Linde Plc	1.225	PPG Industries Inc	2.333
Tesla Inc	1.150	Meta Platforms Inc 'A'	2.295
Target Corp	1.073	Sempra	2.256
US Bancorp	1.026	Becton Dickinson & Co	2.195
Starbucks Corp	992	Exxon Mobil Corp	2.158
BJ's Wholesale Club Holdings Inc	980	UnitedHealth Group Inc	2.097
Nestle SA ADR	973	Home Depot Inc/The	2.084
United Parcel Service Inc 'B'	971	Hartford Insurance Group Inc/The	2.002
Adobe Inc	961	Comcast Corp	1.863
Workday Inc 'A'	930	Mondelez International Inc	1.841
Vulcan Materials Co	879	Netflix Inc	1.823
ASML Holding NV	867	US Bancorp	1.779
PepsiCo Inc	720	Visa Inc 'A'	1.765
Eaton Corp Plc	709	JPMorgan Chase & Co	1.728
Sempra	706	Alphabet Inc	1.727
Kinder Morgan Inc	568	Progressive Corp/The	1.526
Stryker Corp	491	Eli Lilly & Co	1.475
NVIDIA Corp	476	ICON Plc	1.461
Emerson Electric Co	407	TJX Cos Inc/The	1.432
Eli Lilly & Co	402	Alphabet Inc 'A'	1.290
Marvell Technology Inc	398	Travelers Cos Inc/The	1.263
		Honeywell International Inc	1.249
		Marvell Technology Inc	1.139
		PepsiCo Inc	1.120

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Automatic Data Processing Inc
Waste Management Inc
Johnson & Johnson
Bank of America Corp

ERLÖSE

(in Tsd.) \$

1.114
1100
1.019
992

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

Alphabet Inc 'A'
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR
Accenture Plc 'A'
Synopsys Inc
Airbnb Inc
Intuit Inc
Novo Nordisk A.S ADR
Tesla Inc
PayPal Holdings Inc
Apple Inc
UnitedHealth Group Inc
Workday Inc 'A'
Equinix Inc
Starbucks Corp
ICON Plc
Salesforce Inc
Visa Inc 'A'
ASML Holding NV
NVIDIA Corp
Union Pacific Corp
Amazon.com Inc
Microsoft Corp
Zoetis Inc
Meta Platforms Inc 'A'

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$

36.522
34.802
29.745
27.979
25.408
17.216
15.891
15.621
13.329
13.232
12.063
11.681
10.639
9.976
9.320
8.998
7.932
6.009
5.958
5806
5.519
4.812
4.780
4.405

WICHTIGSTE VERKÄUFE

NVIDIA Corp
Netflix Inc
Alcon Inc
NextEra Energy Inc
NIKE Inc
Atlassian Corp
Visa Inc 'A'
UnitedHealth Group Inc
Meta Platforms Inc 'A'
United Parcel Service Inc 'B'
Thermo Fisher Scientific Inc
Intel Corp
Microsoft Corp
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'
Intercontinental Exchange Inc
Eli Lilly & Co
Equinix Inc
WW Grainger Inc
Aptiv Plc
Adobe Inc
Intuitive Surgical Inc
Eaton Corp Plc
Amazon.com Inc
Uber Technologies Inc
Palo Alto Networks Inc
Sherwin-Williams Co/The
Apple Inc
Accenture Plc 'A'

ERLÖSE (in Tsd.) \$

70.377
33.605
23.975
22.600
21.092
19.128
19.005
18.648
16.774
15.790
15.447
15.135
14.849
14.750
13.781
13.037
12.796
12.687
12.581
12.487
11.982
11.558
9.891
7.456
6.873
5.611
5.568
5.440

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

Crowdstrike Holdings Inc
AppLovin Corp 'A'
Vertiv Holdings Co 'A'
Palantir Technologies Inc
Old Dominion Freight Line Inc
Ares Management Corp 'A'
MSCI Inc 'A'
Chipotle Mexican Grill Inc 'A'
elf Beauty Inc
Builders FirstSource Inc
Tractor Supply Co
Shopify Inc 'A'
IDEXX Laboratories Inc
Robinhood Markets Inc
WW Grainger Inc
Clean Harbors Inc
Cava Group Inc
Pinterest Inc
TJX Cos Inc/The
MongoDB Inc 'A'

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$

7.381
4.356
3.918
3.595
3.595
3.417
3.361
3.242
2.974
2.390
2.358
2.198
1.961
1.784
1.717
1.513
1.410
913
864
760

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Crowdstrike Holdings Inc
Broadcom Inc
Comcast Corp
UnitedHealth Group Inc
Autodesk Inc
Vertex Pharmaceuticals Inc
AbbVie Inc
Biogen Inc
Dolby Laboratories Inc 'A'
Ionis Pharmaceuticals Inc
HubSpot Inc
Diageo Plc ADR
Madison Square Garden Sports Corp
Seagate Technology Holdings Plc
Charles River Laboratories International Inc
Western Digital Corp
Johnson Controls International plc
TE Connectivity Ltd
Etsy Inc
Meta Platforms Inc 'A'
Wolfspeed Inc
Snowflake Inc
Accenture Plc 'A'
ServiceNow Inc

ERLÖSE (in Tsd.) \$

16.422
11.037
7.385
7.262
6.130
5.867
4.443
3.952
3.012
2.885
2.857
2.669
2.653
2.533
2.405
1.960
1.700
1.628
1.620
1.481
1.293
1.236
1.145
1.145
1.047

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Texas Instruments Inc	1.044	Texas Instruments Inc	1.085
QUALCOMM Inc	967	Broadcom Inc	1.033
Comcast Corp	713	Apple Inc	1.010
Hewlett Packard Enterprise Co	690	QUALCOMM Inc	917
NXP Semiconductors NV	671	Blackstone Inc	912
Salesforce Inc	621	DTE Energy Co	746
Roche Holding AG ADR	615	Semptra	692
Lennar Corp	612	Comcast Corp	673
Honeywell International Inc	610	US Bancorp	635
Lineage Inc	610	Apartment Income REIT Corp	595
Citigroup Inc	605	Nestle SA ADR	536
Nestle SA ADR	586	Oracle Corp	522
ASML Holding NV	570	NextEra Energy Partners LP	509
Bank of America Corp	565	Extra Space Storage Inc	509
Boeing Co/The	545	Apollo Global Management Inc	438
Broadcom Inc	524	NextEra Energy Inc	437
Ares Management Corp, Series B	516	Microsoft Corp	435
Intuit Inc	515	Marvell Technology Inc	419
MetLife Inc	514	Prologis Inc	396
Cheniere Energy Inc	507	Coca-Cola Co/The	394
Alexandria Real Estate Equities Inc	493	Pfizer Inc	369
Public Service Enterprise Group Inc	471	ASML Holding NV	367
McKesson Corp	469	Merck & Co Inc	356
Alphabet Inc 'A'	400	Exxon Mobil Corp	335
Equity Residential	385	Digital Realty Trust Inc	323
Northrop Grumman Corp	384	Equity LifeStyle Properties Inc	307
US Bancorp	375	Public Service Enterprise Group Inc	303
Emerson Electric Co	370	American Homes 4 Rent 'A'	297
Edison International	337	Blue Owl Capital Inc 'A'	295
NextEra Energy Inc	315	Abbott Laboratories	294
Charles Schwab Corp/The	297	NXP Semiconductors NV	293
Equity LifeStyle Properties Inc	270	Amphenol Corp 'A'	281
Gaming and Leisure Properties Inc	267	Gaming and Leisure Properties Inc	275
Equinix Inc	232	Emerson Electric Co	275
Ares Capital Corp	221	Intuit Inc	272
UnitedHealth Group Inc	217	Equinix Inc	270
JPMorgan Chase & Co	214	Boston Properties Inc	262
		Edison International	260
		United Parcel Service Inc 'B'	259
		CME Group Inc	254
		JPMorgan Chase & Co	240
		Target Corp	234

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Amazon.com Inc	55.623	Microsoft Corp	54.287
NVIDIA Corp	42.117	JPMorgan Chase & Co	41.141
Republic Services Inc 'A'	22.534	Eaton Corp Plc	39.961
Vulcan Materials Co	18.936	Costco Wholesale Corp	34.619
Bank of America Corp	18.492	Apple Inc	31.492
ServiceNow Inc	17.340	Alphabet Inc 'A'	29.980
Adobe Inc	16.776	Trane Technologies Plc	27.425
McKesson Corp	15.348	Williams-Sonoma Inc	27.246
MetLife Inc	13.264	Veralto Corp	25.470
United Rentals Inc	11.990	Hartford Insurance Group Inc/The	24.959
Broadcom Inc	9.057	Hologic Inc	21.281
Chewy Inc 'A'	9.006	Ball Corp	20.512
Dell Technologies Inc	6.345	Gilead Sciences Inc	20.230
Ball Corp	5.954	Cisco Systems Inc	18.209
Argenx SE ADR	5.511	Ecolab Inc	17.732
Reddit Inc	5.365	Dell Technologies Inc	17.329
Enphase Energy Inc	5.365	Amazon.com Inc	17.178
Accenture Plc 'A'	5.121	Booking Holdings Inc	16.837
Colgate-Palmolive Co	3.914	Salesforce Inc	16.344
LKQ Corp	3.443	Morgan Stanley	16.299
ASML Holding NV	3.349	Broadcom Inc	15.895
		Colgate-Palmolive Co	15.786
		Danaher Corp	14.483
		Home Depot Inc/The	14.087
		McCormick & Co Inc/MD	13.506
		UnitedHealth Group Inc	12.712
		Regal Rexnord Corp	12.234
		NVIDIA Corp	12.125
		Visa Inc 'A'	12.003
		Novo Nordisk A.S ADR	11.640
		Accenture Plc 'A'	11.056
		Travelers Cos Inc/The	11.004
		NIKE Inc	10.756
		Marvell Technology Inc	10.592

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Trex Co Inc	10.385
Adobe Inc	10.340
Ormat Technologies Inc	10.261
Procter & Gamble Co/The	9.645
Johnson & Johnson	9.417
CVS Health Corp	9.072
American Water Works Co Inc	8.930
Prologis Inc	8.921

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

NVIDIA Corp	802
Apple Inc	600
T-Mobile US Inc	596
Microsoft Corp	557
Amazon.com Inc	546
Alphabet Inc 'A'	497
Danone SA	470
KKR & Co Inc	461
Broadcom Inc	458
Chubb Ltd	454
Republic Services Inc 'A'	439
CRH Plc	396
Sea Ltd ADR	394
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	386
Meta Platforms Inc 'A'	379
Costco Wholesale Corp	371
Eli Lilly & Co	370
Dollarama Inc	367
Old Dominion Freight Line Inc	349
Intesa Sanpaolo SpA	347
Intuitive Surgical Inc	346
Lenovo Group Ltd	344
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	343
Marsh & McLennan Cos Inc	341
Trane Technologies Plc	337
Constellation Software Inc/Canada	334
London Stock Exchange Group Plc	325
Union Pacific Corp	323
Unilever Plc	320
RELX Plc	311
Lloyds Banking Group Plc	308
SK Hynix Inc	294
Bank of America Corp	293
JPMorgan Chase & Co	291
UCB SA	290
Terumo Corp	287
Tokio Marine Holdings Inc	284
Equinix Inc	278
Novo Nordisk A/S	274
Publicis Groupe SA	268
Intercontinental Exchange Inc	267
ABB Ltd	266
Target Corp	262

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$

WICHTIGSTE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Marvell Technology Inc	826
Eli Lilly & Co	644
CRH Plc	453
Uber Technologies Inc	446
NVIDIA Corp	425
Loblaw Cos Ltd	420
NextEra Energy Inc	417
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	410
Netflix Inc	378
Target Corp	369
Haleon Plc	361
ASML Holding NV	355
Alphabet Inc 'A'	343
Chubb Ltd	340
Apple Inc	335
Amphenol Corp 'A'	320
Shopify Inc 'A'	300
TransDigm Group Inc	292
Meta Platforms Inc 'A'	279
Industria de Diseno Textil SA	279
Monolithic Power Systems Inc	274
Olympus Corp	267
London Stock Exchange Group Plc	262
Salesforce Inc	261
Amazon.com Inc	257
McKesson Corp	255
Hoya Corp	248
Microsoft Corp	244
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	240
Deutsche Telekom AG	237
Coty Inc	233
Alcon Inc	226
ICON Plc	225
Accenture Plc 'A'	225
Monday.com Ltd	223
Thermo Fisher Scientific Inc	220
SAP SE	209
MercadoLibre Inc	199
Brambles Ltd	197
S&P Global Inc	196
Keyence Corp	194

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE

TC Energy Corp	36.507
Emera Inc	34.438
WEC Energy Group Inc	29.804
Canadian National Railway Co	24.916
DTE Energy Co	23.003
Vinci SA	21.321
ONEOK Inc	20.985
Aena SME SA, 144A	18.432
Redeia Corp SA	16.078
APA Group	14.307
Enel SpA	13.588
E.ON SE	13.314
Williams Cos Inc/The	12.488
NextEra Energy Inc	10.028
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	9.238
Ferrovial SE	8.924
Pembina Pipeline Corp	8.532
Equatorial Energia SA	8.443
Getlink SE	8.149
Cheniere Energy Inc	6.800
Entergy Corp	6.782
CSX Corp	6.177

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €

WICHTIGSTE VERKÄUFE

	ERLÖSE (in Tsd.) €
American Tower Corp	35.549
PG&E Corp	30.191
EDP SA	26.419
Crown Castle Inc	25.346
CSX Corp	25.021
Norfolk Southern Corp	24.512
Public Service Enterprise Group Inc	22.866
Orsted A/S, 144A	22.329
Constellation Energy Corp	21.563
Getlink SE	20.835
Entergy Corp	19.818
Dominion Energy Inc	19.585
NextEra Energy Inc	18.960
Enel SpA	18.083
Gibson Energy Inc	17.929
Pembina Pipeline Corp	16.359
Transurban Group	16.271
Ferrovial SE	15.894
Central Japan Railway Co	15.543
East Japan Railway Co	15.027
Seyn Trent Plc	13.488
Rumo SA	12.563

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
Crown Castle Inc	5.956	Union Pacific Corp	10.941
PG&E Corp	5.699	Centrais Eletricas Brasileiras SA	10.503
Constellation Energy Corp	5.650	Cheniere Energy Inc	9.342
Terna – Rete Elettrica Nazionale	5.609	CenterPoint Energy Inc	9.326
CenterPoint Energy Inc	5.336	United Utilities Group Plc	8.722
OGE Energy Corp	5.322	OGE Energy Corp	8.621
Centrais Eletricas Brasileiras SA	5.034	E.ON SE	8.467
		Redeia Corp SA	8.205
		Equatorial Energia SA	8121
		Terna – Rete Elettrica Nazionale	7.400
		Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	7.308
		Aeroports de Paris SA	7.154
		TC Energy Corp	6.066

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
TC Energy Corp	19.022	Enel SpA	18.274
Enbridge Inc	17.176	Dominion Energy Inc	15.989
Enel SpA	16.885	Southern Co/The	15.644
Emera Inc	12.184	National Grid Plc	15.471
South Bow Corp	11.723	American Tower Corp	14.913
Vinci SA	10.662	Iberdrola SA	13.794
Dominion Energy Inc	10.487	Eversource Energy	12.620
E.ON SE	9.601	TC Energy Corp	12.227
WEC Energy Group Inc	9.213	Enbridge Inc	11.802
ONEOK Inc	9.174	Entergy Corp	10.762
Severn Trent Plc	8.697	West Japan Railway Co	10.730
Aena SME SA, 144A	8.100	Public Service Enterprise Group Inc	9.799
National Grid Plc	7.960	Ferrovial SE	9.427
APA Group	7.571	Snam SpA	8.841
Snam SpA	6.380	EDP SA	8.150
Williams Cos Inc/The	6353	OGE Energy Corp	7.276
Iberdrola SA	6.281	China Resources Gas Group Ltd	6.788
Redeia Corp SA	5910	South Bow Corp	6.779
NextEra Energy Inc	5.595	Transurban Group	6.741
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	5.097	NextEra Energy Inc	6.511
SSE Plc	4.437	Pembina Pipeline Corp	6.005
Italgas SpA	3.530	Constellation Energy Corp	5.776
Pennon Group Plc	3.521	Gibson Energy Inc	5.681
OGE Energy Corp	3.385	NextEra Energy Partners LP	5.534
Brookfield Renewable Corp	3.128	Union Pacific Corp	5.290
Crown Castle Inc	2.525	Crown Castle Inc	5.275
Pembina Pipeline Corp	2.486	CCR SA	4.428
Centrais Eletricas Brasileiras SA	2482	Aeroports de Paris SA	4.229
		Enagas SA	4.040
		Redeia Corp SA	3.721
		E.ON SE	3.601
		United Utilities Group Plc	3.533
		Atlas Arteria Ltd	3388
		Severn Trent Plc	3.161

FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Compass Group Plc	234	Vertiv Holdings Co 'A'	273
PayPal Holdings Inc	226	Compass Group Plc	262
National Grid Plc	195	Hitachi Ltd	207
ICON Plc	161	Schneider Electric SE	191
Teck Resources Ltd	146	Meta Platforms Inc 'A'	179
CNH Industrial NV	139	Veolia Environnement SA	171
EQT Corp	137	BNP Paribas SA	160
Johnson & Johnson	135	Oracle Corp	154
Bureau Veritas SA	130	Fiserv Inc	143
Fortune Brands Innovations Inc	130	Freeport-McMoRan Inc	138
CVS Health Corp	129	Chesapeake Energy Corp	134
Piraeus Financial Holdings SA ADR	129	Johnson & Johnson	130
Charles Schwab Corp/The	125	UnitedHealth Group Inc	114
Johnson Controls International plc	121	AIA Group Ltd	101
Siemens Energy AG	97	AES Corp/The	92
NextEra Energy Inc	68	Brookfield Renewable Corp	80
Veolia Environnement SA	62	Biogen Inc	60
Nexans SA	36		
Gerresheimer AG	33		
Biogen Inc	32		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	249.109
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	264.696	Triumph Group Inc	10.024
Victory Capital Holdings Inc 'A'	6.770	Solaris Energy Infrastructure Inc 'A'	8.174
Azenta Inc	6.185	Carpenter Technology Corp	8.007
I3 Verticals Inc 'A'	6.092	Summit Materials Inc 'A'	7.796
Astrana Health Inc	5.909	Cross Country Healthcare Inc	7.758
Enovis Corp	5.667	Benchmark Electronics Inc	7.312
SunOpta Inc	5.590	Applied Optoelectronics Inc	7.142
Penguin Solutions Inc	5.462	Argan Inc	6.216
Evolent Health Inc 'A'	5.321	Coherent Corp	5.898
Kodiak Gas Services Inc	5.251	Nordstrom Inc	5.792
Five9 Inc	5.246	Kyndryl Holdings Inc	4.984
Chart Industries Inc	5.180	Modine Manufacturing Co	4.617
Ingevity Corp	5.033	SecureWorks Corp	4.590
SandRidge Energy Inc	4.947	Primoris Services Corp	4.260
Endava Plc ADR	4.922	Manitex International Inc	4.068
Aviat Networks Inc	4.812	ACV Auctions Inc	4.017
NCR Atleos Corp	4.793	Asbury Automotive Group Inc	4.004
Helios Technologies Inc	4.763	Chart Industries Inc	3.998
Lions Gate Entertainment Corp	4.735	Brighthouse Financial Inc	3.992
Ichor Holdings Ltd	4.519		

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	28.726
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	28.857	Louisiana-Pacific Corp	2.611
M/I Homes Inc	2.689	Champion Homes Inc	2.398
Enovis Corp	2.315	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2.192
Haemonetics Corp	2.228	Leonardo DRS Inc	2.103
Axcelis Technologies Inc	1.924	Houlihan Lokey Inc 'A'	1.677
Visteon Corp	1.862	ESCO Technologies Inc	1.612
Sanmina Corp	1.837	FormFactor Inc	1.576
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.774	Gentex Corp	1.511
MKS Instruments Inc	1.515	Bio-Techne Corp	1.495
Quaker Chemical Corp	1.488	Interparfums Inc	1.434
LCI Industries	1.435	Vishay Precision Group Inc	1.402
Interparfums Inc	1.343	Esab Corp	1.353
Cohu Inc	1.320	Lazard Inc 'A'	1.349
Janus International Group Inc	1.229	UFP Technologies Inc	1.232
Bio-Techne Corp	1.206	MKS Instruments Inc	1.214
Knowles Corp	1.143	Arcosa Inc	1.200
Forrester Research Inc	1.118	White Mountains Insurance Group Ltd	1.195
Ziff Davis Inc	1.096	Carter's Inc	1.183
FormFactor Inc	972	Air Lease Corp 'A'	1.178
Lazard Inc 'A'	928	Ziff Davis Inc	1.139
Marcus & Millichap Inc	928	Innospec Inc	1.117
Envista Holdings Corp	904	Brady Corp 'A'	1.115
Kennedy-Wilson Holdings Inc	891	JBT Marel Corp	1.088
Installed Building Products Inc	888	Kimball Electronics Inc	1.082
Weatherford International Plc	879	Brunswick Corp.DE	1.056
Brunswick Corp.DE	844	Korn Ferry	1.050
		Enpro Inc	1.039
		Kennedy-Wilson Holdings Inc	929
		Steven Madden Ltd	923
		Catalyst Pharmaceuticals Inc	923
		Dun & Bradstreet Holdings Inc	917
		Kadant Inc	881

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.038
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	951	FirstService Corp	153
FirstService Corp	127	Colliers International Group Inc	139
Johns Lyng Group Ltd	107	Learning Technologies Group Plc	78
Colliers International Group Inc	105	Restore Plc	76
Riken Keiki Co Ltd	88	Rogers Corp	66
Maruwa Co Ltd/Aichi	80	Ziff Davis Inc	64
Ashtead Technology Holdings plc	77	Ralph Lauren Corp 'A'	64
Gaztransport Et Technigaz SA	70	Kadant Inc	58
LCI Industries	65	FormFactor Inc	57
CTS Eventim AG & Co KGaA	64	Croda International Plc	43
CVS Group Plc	61	Gentex Corp	39
Robertet SA	57	UFP Industries Inc	37
Dorman Products Inc	54	Lincoln Electric Holdings Inc	37
JTC Plc, 144A	50	Spirax-Sarco Engineering Plc	34
Rightmove Plc	45	Asseco Poland SA	34
Antin Infrastructure Partners SA	43	Optima Health PLC	32
Quaker Chemical Corp	42		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Axcelis Technologies Inc	35	Miura Co Ltd	32
Halma Plc	35	Interparfums Inc	32
Norva24 Group AB	34	Valmont Industries Inc	31
Simpson Manufacturing Co Inc	34		
Brady Corp 'A'	31		
Littelfuse Inc	31		
RB Global Inc	29		
DiscoverIE Group Plc	28		

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	40.686	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	42.108
Novo Nordisk A/S	4.397	NVIDIA Corp	16.246
Partners Group Holding AG	3.179	ASML Holding NV	7.258
Apple Inc	1.840	Microsoft Corp	6.693
Meta Platforms Inc 'A'	1.473	Ferrari NV	5.496
Deckers Outdoor Corp	1.437	Linde Plc	5.253
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	1.415	Atlas Copco AB	4.565
Zoetis Inc	1.408	Moncler SpA	4.402
Sartorius Stedim Biotech	1.347	L'Oreal SA	4.348
IDEXX Laboratories Inc	1.271	Mastercard Inc	4.001
L'Oreal SA	1.158	Kingspan Group Plc	3.951
BE Semiconductor Industries NV	1.055	Sartorius Stedim Biotech	3.878
Moncler SpA	990	Cadence Design Systems Inc	3.781
Constellation Software Inc/Canada	814	Zoetis Inc	3.695
Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	812	Adyen NV, 144A	3.658
Lululemon Athletica Inc	554	Illumina Inc	3.642
Veeva Systems Inc 'A'	536	Assa Abloy AB	3.331
Autodesk Inc	403	Novo Nordisk A/S	3.312
ASML Holding NV	373	CSL Ltd	3.226
Microsoft Corp	336	ResMed Inc	3.211
		Coloplast A.S	3.182
		Mettler-Toledo International Inc	2.940
		IDEXX Laboratories Inc	2.823
		Partners Group Holding AG	2.693
		Hexagon AB	2.633
		Autodesk Inc	2.526
		Veeva Systems Inc 'A'	2.458
		Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	2.374
		Croda International Plc	2.251
		Pernod Ricard SA	2.102
		NIKE Inc	1.883

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4.643	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	4.785
APA Group	320	Aurizon Holdings Ltd	1.423
Chorus Ltd	106	Scentre Group	1.328
Mapletree Industrial Trust	85	Embassy Office Parks REIT	1.264
Frasers Centrepoint Trust	85	Chorus Ltd	1.173
		Link REIT	958
		Power Grid Corp of India Ltd	949
		APA Group	904
		Guangdong Investment Ltd	812
		Charter Hall Retail REIT	783
		GPT Group/The	674
		China Tower Corp Ltd, 144A	669
		Vicinity Ltd	637
		Wharf Real Estate Investment Co Ltd	612
		CLP Holdings Ltd	601
		Capitaland India Trust	589
		Mapletree Industrial Trust	587
		China Merchants Port Holdings Co Ltd	560
		Digital Telecommunications Infrastructure Fund	557
		Fortune Real Estate Investment Trust	553
		Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	534
		Transurban Group	531
		Stockland	525
		AGL Energy Ltd	495
		Westports Holdings Bhd	494
		Contact Energy Ltd	453
		Kiwi Property Group Ltd	418
		NETLINK NBN TRUST	377
		Capitaland Integrated Commercial Trust	375
		Manila Electric Co	342
		Region RE Ltd	273

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	7.183
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	6.768	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.419
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.165	Maruti Suzuki India Ltd	701
Quanta Computer Inc	1.021	SK Hynix Inc	684
MediaTek Inc	948	Tencent Holdings Ltd	633
Mahindra & Mahindra Ltd	590	Samsung Electronics Co Ltd	596
Shinhan Financial Group Co Ltd	530	Asian Paints Ltd	394
Apollo Hospitals Enterprise Ltd	503	Antofagasta Plc	382
Trip.com Group Ltd ADR	395	Credicorp Ltd	267
Tencent Holdings Ltd	377	Mint Group Ltd	259
BYD Co Ltd	335	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	240
Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	309	HDFC Bank Ltd	238
HDFC Bank Ltd	308	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	233
Samsung Electronics Co Ltd	287	ICICI Bank Ltd	230
MakeMyTrip Ltd	250	NAVER Corp	226
Eastroc Beverage Group Co -A	235	Cosan SA	224
SK Hynix Inc	181	Delta Electronics Inc	224
ICICI Bank Ltd	180	Samsung SDI Co Ltd	214
Alibaba Group Holding Ltd	179	Reliance Industries Ltd	212
Delta Electronics Inc	172	Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	188
Meituan 'B', 144A	143		

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
WICHTIGSTE KÄUFE		Ferrari NV	13.381
Novo Nordisk A/S	9.969	ASML Holding NV	11.838
Schneider Electric SE	2.908	Nemetschek SE	7.692
Sartorius Stedim Biotech	2.853	Moncler SpA	7.421
AstraZeneca Plc	2.807	Linde Plc	7.418
Ferrari NV	1.651	Assa Abloy AB	7.082
ASML Holding NV	1.422	Atlas Copco AB	6.108
Moncler SpA	1.217	Mettler-Toledo International Inc	6.025
L'Oreal SA	1.210	Kingspan Group Plc	5.976
Kingspan Group Plc	1.142	L'Oreal SA	5.954
Assa Abloy AB	1.078	Hexagon AB	5.768
Dassault Systemes SE	1.009	Sartorius Stedim Biotech	5.247
Linde Plc	979	Partners Group Holding AG	5.193
Coloplast A.S	968	Croda International Plc	5.024
Galderma Group AG	942	Coloplast A.S	4.998
Partners Group Holding AG	942	Adyen NV, 144A	4.548
Nemetschek SE	930	Kering SA	4.464
Mettler-Toledo International Inc	904	Dassault Systemes SE	4.119
Atlas Copco AB	902	Novo Nordisk A/S	3.895
BE Semiconductor Industries NV	822	Pernod Ricard SA	3.622
Adyen NV, 144A	767	BE Semiconductor Industries NV	3536
Croda International Plc	519	Infineon Technologies AG	1.804
Hexagon AB	442		
Kering SA	422		
Infineon Technologies AG	411		

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		Intuitive Surgical Inc	377
MercadoLibre Inc	851	Xylem Inc.NY	328
Intuitive Surgical Inc	811	Deere & Co	288
Tyler Technologies Inc	685	Masimo Corp	254
Xylem Inc.NY	668	Novonesis (Novozymes) B	220
HDFC Bank Ltd ADR	616	MercadoLibre Inc	219
Valmont Industries Inc	606	Valmont Industries Inc	217
Revvity Inc	597	Ecolab Inc	165
Ecolab Inc	565	Revvity Inc	164
Halma Plc	565	HDFC Bank Ltd ADR	157
Novonesis (Novozymes) B	552	Croda International Plc	155
Veolia Environnement SA	493	Airtel Africa Plc, 144A	143
Deere & Co	477	Veeva Systems Inc 'A'	134
Veeva Systems Inc 'A'	475	Tyler Technologies Inc	132
Amplifon SpA	453	Veolia Environnement SA	126
Airtel Africa Plc, 144A	427	Amplifon SpA	112
Verra Mobility Corp 'A'	426	Stride Inc	102
Illumina Inc	384	Halma Plc	101
Exponent Inc	371	Everbridge Inc	95
Croda International Plc	353	Verra Mobility Corp 'A'	93
Vistry Group Plc	313	Illumina Inc	91
Emirates Central Cooling Systems Corp	306	MIPS AB	73
Stride Inc	294	Planet Fitness Inc 'A'	73
Planet Fitness Inc 'A'	253	Emirates Central Cooling Systems Corp	72
MIPS AB	248	Vistry Group Plc	62
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	246	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	59
Coursera Inc	146		
Energy Recovery Inc	136		
Mears Group Plc	134		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Portfolios (ungeprüft) – (Fortsetzung)

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE

Spanien, Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2028	2.956
US Bancorp, 3,329 %, fällig 21.05.2028	1.000
Internationale Staatsanleihe Island, 3,400 %, fällig 28.06.2027	998
OTP Bank Nyrt, 4,750 %, fällig 12.06.2028	996
Prysman SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028	701
Ceska sporitelna AS, 0,500 %, fällig 13.09.2028	651
BAWAG PSK Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse AG, 0,375 %, fällig 03.09.2027	558
NatWest Markets Plc, 4,250 %, fällig 13.01.2028	310
UBS Group AG, 4,625 %, fällig 17.03.2028	309
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 19.02.2028	187
Barry Callebaut Services NV, 3,750 %, fällig 19.02.2028	100
DSV Finance BV, EMTN, 3,125 %, fällig 06.11.2028	100

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €

2.956
1.000
998
996
701
651
558
310
309
187
100
100

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Logicor Financing Sarl, 4,625 %, fällig 25.07.2028	1.546
Telenor ASA, 0,250 %, fällig 14.02.2028	1.322
PVH Corp, 3,125 %, fällig 15.12.2027	1.293
TDF Infrastructure SASU, 5,625 %, fällig 21.07.2028	1.252
LKQ European Holdings BV, 4,125 %, fällig 01.04.2028	1.200
Adevinta ASA, 3,000 %, fällig 15.11.2027	609
CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01.02.2028	550
Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, fällig 01.02.2028	380
Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	367
Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig 21.06.2028	357
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027	355
Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig 15.11.2027	352
Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	350
IMA Industria Machine Automatiche SpA, 3,750 %, fällig 15.01.2028	330
Iliad Holding SASU, 5,625 %, fällig 15.10.2028	327
UBS Group AG, 4,625 %, fällig 17.03.2028	310
AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028	291
Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig 02.11.2028	276
Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig 01.03.2028	270
RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	209
Crown European Holdings SACA, 5,000 %, fällig 15.05.2028	209
Coty Inc, 5,750 %, fällig 15.09.2028	209
ING Groep NV, 4,875 %, fällig 14.11.2027	207
Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 22.03.2028	194
Orano SA, 2,750 %, fällig 08.03.2028	191
Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028	191
H Lundbeck A.S, 0,875 %, fällig 14.10.2027	189
Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig 15.10.2027	187
Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,125 %, fällig 07.03.2028	184
Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	183
NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig 13.12.2028	176

ERLÖSE (in Tsd.) €

1.546
1.322
1.293
1.252
1.200
609
550
380
367
357
355
352
350
330
327
310
291
276
270
209
209
209
207
194
191
191
189
187
184
183
176

Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE

Italien, Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 5Y, 3,000 %, fällig 01.10.2029	1.313
Internationale Staatsanleihe Rumänien, 6,625 %, fällig 27.09.2029	871
Raiffeisenbank AS, 1,000 %, fällig 09.06.2028	820
Logicor Financing Sarl, 4,250 %, fällig 18.07.2029	809
Landsbankinn HF, 5,000 %, fällig 13.05.2028	721
Standard Chartered Plc, 0,800 %, fällig 17.11.2029	712
BPCE SA, 3,875 %, fällig 11.01.2029	702
CaixaBank SA, 5,000 %, fällig 19.07.2029	629
NatWest Group Plc, 4,771 %, fällig 16.02.2029	622
Societe Generale SA, 4,750 %, fällig 28.09.2029	622
Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029	621
Jyske Bank A/S, 4,875 %, fällig 10.11.2029	621
Lloyds Banking Group Plc, 4,500 %, fällig 11.01.2029	619
ING Groep NV, 4,500 %, fällig 23.05.2029	617
KBC Group NV, 4,250 %, fällig 28.11.2029	616
Credit Agricole SA, 0,500 %, fällig 21.09.2029	614
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig 07.08.2029	611
Aroundtown SA, 4,800 %, fällig 16.07.2029	608
Credit Mutuel Arkea SA, 3,500 %, fällig 09.02.2029	593
WMG Acquisition Corp, 2,750 %, fällig 15.07.2028	574
UBS Group AG, 7,750 %, fällig 01.03.2029	567
Nexi SpA, 2,125 %, fällig 30.04.2029	549
Autostrade per l'Italia SpA, 1,875 %, fällig 26.09.2029	546
Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,875 %, fällig 18.06.2029	546
Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig 31.10.2028	534
Banco de Sabadell SA, 5,500 %, fällig 08.09.2029	527
Commerzbank AG, 5,250 %, fällig 25.03.2029	524
Unicaja Banco SA, 5,125 %, fällig 21.02.2029	520
Nykredit Realkredit AS, 4,625 %, fällig 19.01.2029	519
SELP Finance Sarl, 0,875 %, fällig 27.05.2029	517
Suez SACA, 4,625 %, fällig 03.11.2028	515
Mundys SpA, 4,750 %, fällig 24.01.2029	513
Forvia SE, 5,125 %, fällig 15.06.2029	508
Ibercaja Banco SA, 4,375 %, fällig 30.07.2028	507
Alstom SA, 0,000 %, fällig 11.01.2029	506
Logicor Financing Sarl, 4,625 %, fällig 25.07.2028	506
ZF Europe Finance BV, 4,750 %, fällig 31.01.2029	503
Cooperatieve Rabobank UA, 3,331 %, fällig 16.07.2028	500
Barry Callebaut Services NV, 4,000 %, fällig 14.06.2029	500
Jyske Bank A/S, EMTN, FRN, 4,125 %, fällig 06.09.2030	500
PVH Corp, 4,125 %, fällig 16.07.2029	499
Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 3,625 %, fällig 20.06.2029	499
Air France-KLM, 4,625 %, fällig 23.05.2029	498
Dell Bank International DAC, 3,625 %, fällig 24.06.2029	497
ISS Global A/S, 3,875 %, fällig 05.06.2029	497
Deutsche Lufthansa AG, 3,500 %, fällig 14.07.2029	493
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, fällig 12.03.2029	483

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €

1.313
871
820
809
721
712
702
629
622
622
621
621
619
617
616
614
611
608
593
574
567
549
546
546
534
527
524
520
519
517
515
513
508
507
506
506
503
500
500
500
499
499
498
497
497
493
483

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Landsbankinn HF, 5,000 %, fällig 13.05.2028	736
PVH Corp, 4,125 %, fällig 16.07.2029	512
Logicor Financing Sarl, 4,625 %, fällig 25.07.2028	512
Jyske Bank A/S EMTN, FRN, 4,125 %, fällig 06.09.2030	503
Logicor Financing Sarl, 4,250 %, fällig 18.07.2029	463
HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01.11.2028	364
Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029	330
BFF Bank SpA FRN, 4,750 %, fällig 20.03.2029	287
Cellnex Telecom SA, 1,875 %, fällig 26.06.2029	283
Argenta Spaarbank NV EMTN, FRN, 1,375 %, fällig 08.02.2029	272
Air France-KLM, 8,125 %, fällig 31.05.2028	226
Piraeus Bank SA emTN, FRN, 6,750 %, fällig 05.12.2029	222
Valeo SE, 5,875 %, fällig 12.04.2029	214
CaixaBank SA, 5,000 %, fällig 19.07.2029	213
Crown European Holdings SACA, 5,000 %, fällig 15.05.2028	211
Lloyds Banking Group Plc, 4,500 %, fällig 11.01.2029	209
Abertis Infraestructuras SA, 4,125 %, fällig 07.08.2029	209
Ibercaja Banco SA, 4,375 %, fällig 30.07.2028	207
Deutsche Lufthansa AG, 3,500 %, fällig 14.07.2029	204
BPCE SA, 3,875 %, fällig 11.01.2029	203
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH, REGS, 5,375 %, fällig 15.07.2029	203
Catalent Pharma Solutions Inc, REGS, 2,375 %, fällig 01.03.2028	201
Nexi SpA, 2,125 %, fällig 30.04.2029	191
IQVIA Inc, REGS, 2,875 %, fällig 15.06.2028	190
Autostrade per l'Italia SpA, 1,875 %, fällig 26.09.2029	189
Raiffeisenbank AS, 1,000 %, fällig 09.06.2028	187
Santander UK Group Holdings Plc, 0,603 %, fällig 13.09.2029	182
Credit Agricole SA, 0,500 %, fällig 21.09.2029	182
SELP Finance Sarl, 0,875 %, fällig 27.05.2029	180
Bank of Ireland Group Plc, 4,625 %, fällig 13.11.2029	106
Mundys SpA, 4,750 %, fällig 24.01.2029	105
KBC Group NV, 4,250 %, fällig 28.11.2029	104
Air France-KLM, 4,625 %, fällig 23.05.2029	103
Barry Callebaut Services NV, 4,000 %, fällig 14.06.2029	102
Heimstaden Bostad AB, EMTN, 3,875 %, fällig 05.11.2029	100
Aptiv Swiss Holdings Ltd, 1,600 %, fällig 15.09.2028	95
IMA Industria Machine Automatiche SpA, 3,750 %, fällig 15.01.2028	94

ERLÖSE (in Tsd.) €

736
512
512
503
463
364
330
287
283
272
226
222
214
213
211
209
209
207
204
203
203
201
191
190
189
187
182
182
180
106
105
104
103
102
100
95
94

[^] 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 gibt definierte Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinie sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinie. 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 wird in Abhängigkeit von der Komplexität der Aufgabe, dem Grad der Verantwortung, der Leistung und den Marktvergleichsdaten festgelegt. 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 2024 gezahlt wurde*, **, ***	10.890.555 €
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2024 gezahlt wurde*, **, ***	9.263.600 €
Anzahl der Mitarbeiter von FTIS und seinen Beauftragten zum 30. September 2024	601
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2024 an die Geschäftsleitung gezahlt haben*, **, ***	5.335.414 €
Von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeiter, die während des Geschäftsjahres zum 30. September 2024 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 2024 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 2024 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 28. Februar 2025 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	140.000	140.000	8,33
HSBC Bank (USA)	Vereinigtes Königreich	75.000	75.000	4,46
JP Morgan Securities LLC	USA	150.000	150.000	8,92
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	2,98
TD Securities (USA) LLC	Kanada	22.443	22.443	1,34
		437.443	437.443	26,03

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 28. Februar 2025:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US-Dollar	446.327 \$

* Sofern es zum 28. Februar 2025 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 28. Februar 2025:

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	446.327 \$

Die nachstehende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der Reverse-Repo-Geschäfte und den damit verbundenen erhaltenen.(bereitgestellten) Sicherheiten zum 28. Februar 2025:

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	–	437.443 \$	–	–	–	–	–	437.443 \$
	Erhaltene unbare Sicherheiten	–	–	–	–	829 \$	445.498 \$	–	446.327 \$

Bei den Reverse-Repo-Geschäften, die für den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, handelt es sich um Dreiparteienvträge. Vom Fonds im Zusammenhang mit den zum 28. Februar 2025 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 28. Februar 2025 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 309 Mio. USD, was 0,09 % 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 28. Februar 2025 endende Geschäftsjahr auf 59.531 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 28. Februar 2025 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 Transaktionen gezahlten Provisionen beliefen sich auf 998.889 USD bei einem durchschnittlichen Provisionssatz von 0,23 Basispunkten. Der Gesamtwert der diesbezüglichen Geschäfte mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen belief sich auf 43.505 Mio. USD, was 2,74 % 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

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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1,37% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - 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

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 wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2025 bei 1,37 %.

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	121,92	96,00%	109,18	64,62%	121,00	95,90%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	188,33	100,00%	203,33	100,00%	235,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	19,72%	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	69,22%	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf eines oder mehrere UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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.

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 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 des unternehmenseigenen Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch negatives Screening, 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 Fonds, 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 verpflichtenden PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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. Wo sie Bedenken hatte und wo es relevant war, bemühte sich die Anlageverwaltung um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, 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, welche 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 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	17,57%	USA
United States of America	Finanzsektor	16,48%	USA
Freddie Mac	Finanzsektor	10,53%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	2,42%	USA
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	2,18%	USA
UBS Group AG	Finanzsektor	1,92%	Schweiz



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

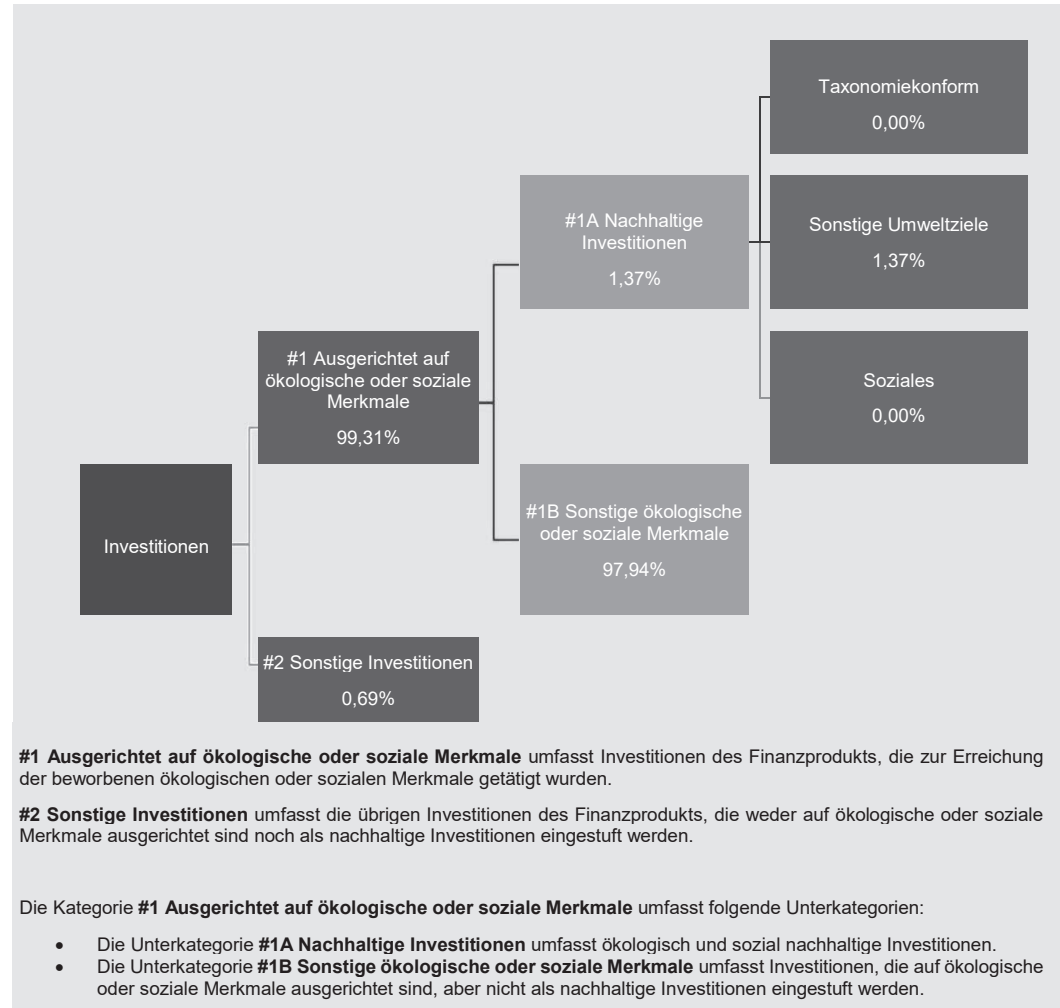
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 1,37 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,31 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,69 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend 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 1,37 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,31%	94,20%	92,20%
#2 Sonstige Investitionen	0,69%	5,80%	7,80%
#1A Nachhaltige Investitionen	1,37%	3,55%	3,30%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	97,94%	90,65%	88,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	1,37%	3,55%	3,30%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	69,99%
Staatsanleihen	9,05%
Energie	4,94%
Kommunikationsdienste	3,79%
Gesundheitssektor	3,68%
Zyklische Konsumgüter	1,76%
Informationstechnologie	1,72%
Versorgungsunternehmen	1,30%
Industrie	1,12%
Grundstoffe	0,84%
Basiskonsumgüter	0,62%
Immobilien	0,49%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	57,42%
Staatsanleihen	9,05%
Banken	8,43%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,79%
Kapitalmärkte	2,99%
Medien	1,61%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,46%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,34%
Pharmaindustrie	1,01%
Stromversorger	0,83%
Allgemeiner Einzelhandel	0,81%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	0,80%
Biotechnologie	0,74%
Metalle u. Bergbau	0,70%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,52%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

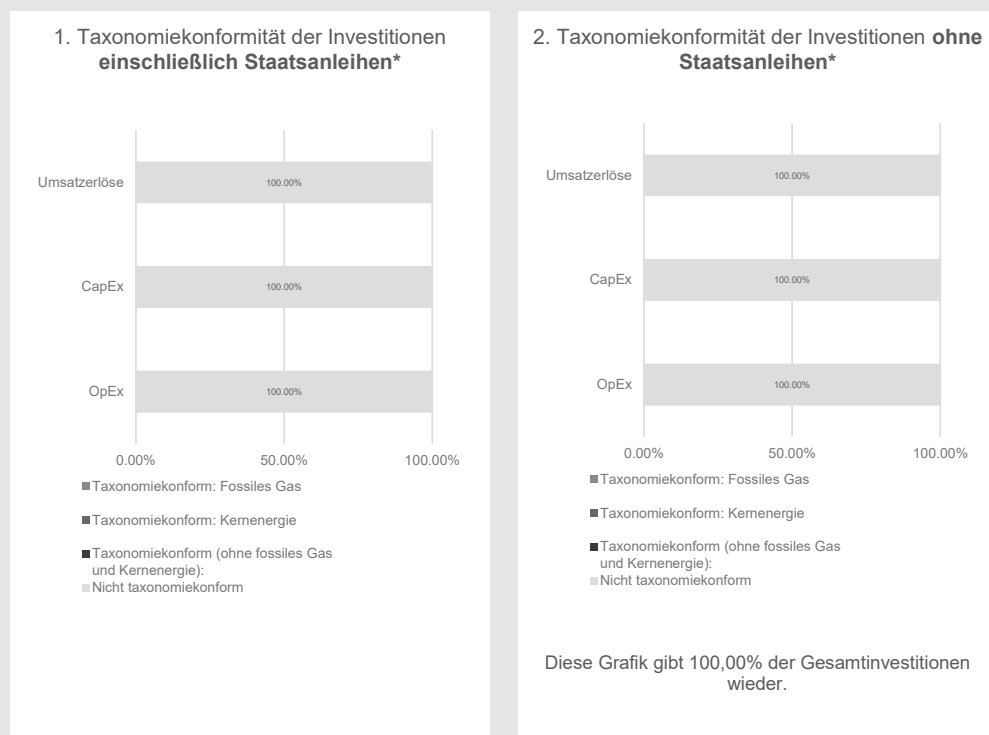
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 1,37 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



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“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) 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 beitrugen.
- 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 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 1,37 % 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 bei 61,2 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 26,1 %.
- D. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 1,37 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Der Fonds hatte 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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,42% 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
- ☐ Es wurden damit 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 wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):

- THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
- Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
- 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 wesentlichen 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 28. Februar 2025 bei 2,42 %.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	817,96	63,34%	151,54	72,43%	149,90	93,20%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	311,36	18,04%	183,19	100,00%	232,10	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	38,08%	0,00%	72,48%	0,00%	92,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	62,90%	0,00%	72,52%	0,00%	92,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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 wie u. a. 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 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 Fonds, 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).

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?

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche verpflichtenden PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	16,44%	USA
United States of America	Finanzsektor	14,05%	USA
Freddie Mac	Finanzsektor	8,31%	USA
UBS Group AG	Finanzsektor	2,89%	Schweiz
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	2,34%	Mexiko
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	2,13%	USA
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	2,04%	USA
CITIGROUP INC.	Finanzsektor	1,83%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

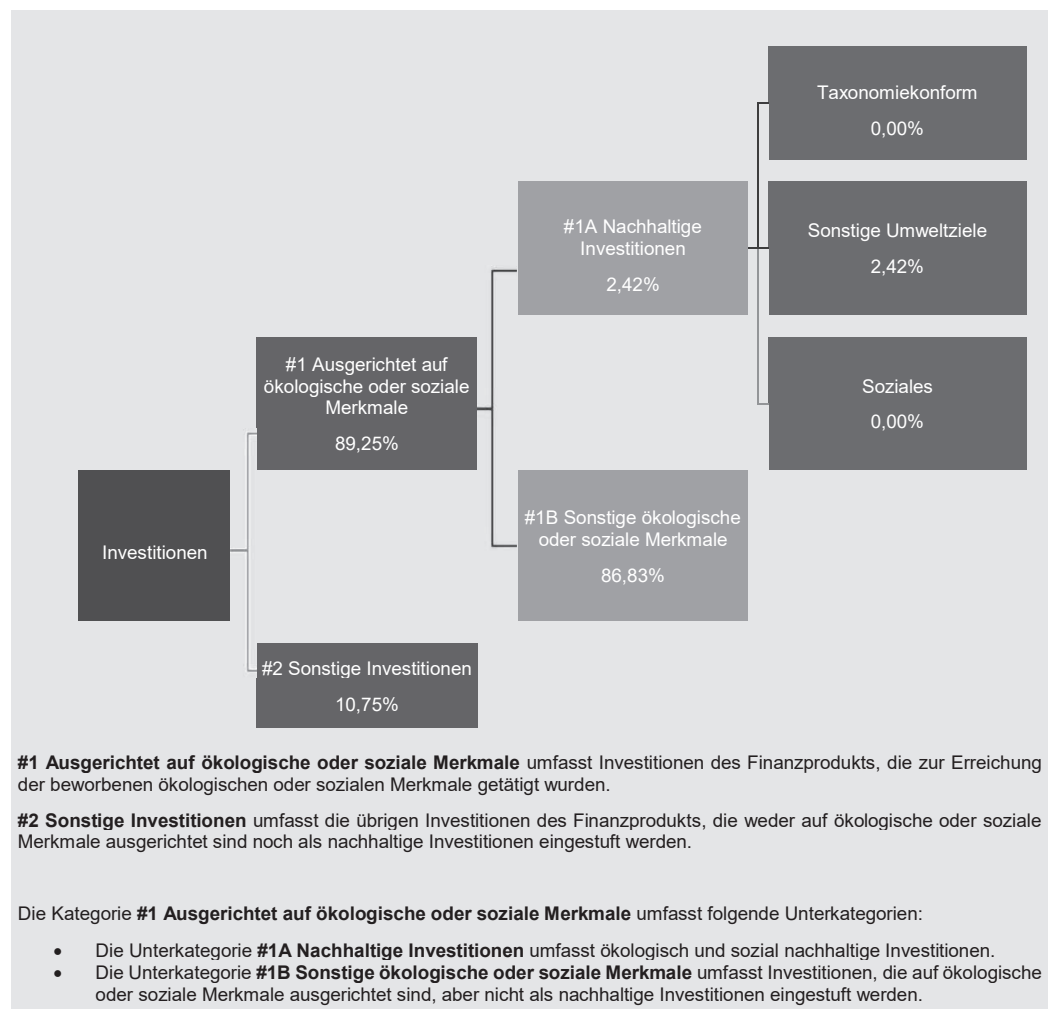
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 2,42 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

89,25 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (10,75 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 2,42 % seines Vermögens in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	89,25%	97,77%	95,20%
#2 Sonstige Investitionen	10,75%	2,23%	4,80%
#1A Nachhaltige Investitionen	2,42%	3,68%	3,30%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	86,83%	94,09%	91,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	2,42%	3,68%	3,30%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	58,39%
Staatsanleihen	10,00%
Energie	4,71%
Kommunikationsdienste	3,92%
Gesundheitssektor	3,89%
Zyklische Konsumgüter	2,59%
Industrie	1,44%
Versorgungsunternehmen	1,08%
Informationstechnologie	1,04%
Grundstoffe	0,95%
Immobilien	0,75%
Basiskonsumgüter	0,49%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	46,96%
Staatsanleihen	10,00%
Banken	7,01%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,58%
Kapitalmärkte	2,73%
Medien	1,98%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,67%
Pharmaindustrie	1,15%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,12%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	0,99%
Stromversorger	0,68%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,60%
Biotechnologie	0,56%
Automobilindustrie	0,56%
Metalle u. Bergbau	0,52%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



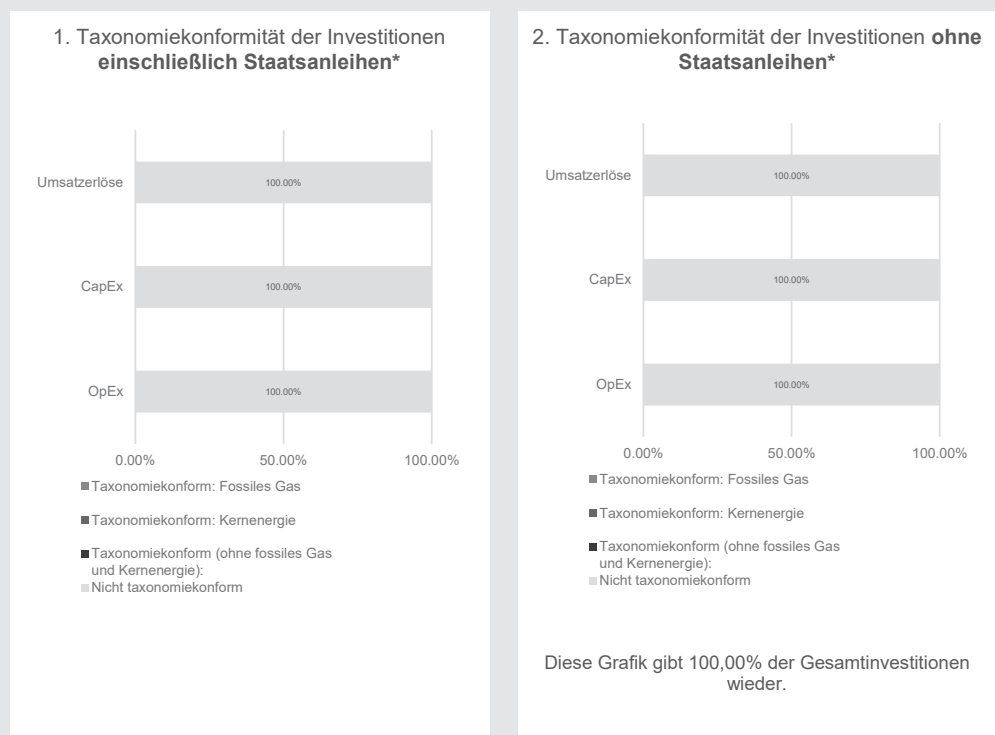
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.

 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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 2,42 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 10,75 % 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:

- 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“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) 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 beitrugen.
- 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 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 2,42 % 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 bei 76,9 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 25,5 %.
- D. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 2,42 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Der Fonds hatte 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,76% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - 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

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 nachstehenden Werte – sie bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2025 bei 2,76 %.

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	1 167,23	41,70%	152,74	48,45%	184,30	80,40%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	375,71	39,20%	211,94	100,00%	245,00	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	49,53%	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	43,31%	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● 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 erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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 wie u. a. 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 Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ 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).

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?

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche verpflichtenden PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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 oben 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
United States of America	Finanzsektor	27,20%	USA
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	2,62%	Mexiko
Rzeczpospolita Polska	Staatsanleihen	1,68%	Polen
Republic of South Africa	Staatsanleihen	1,61%	Südafrika
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	1,32%	USA
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	1,20%	USA
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	1,12%	USA
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	1,12%	Frankreich
Republica Federativa do Brasil	Staatsanleihen	1,05%	Brasilien
Pemerintah Republik Indonesia	Staatsanleihen	1,01%	Indonesien
Bundesrepublik Deutschland	Staatsanleihen	0,96%	Deutschland
FORD MOTOR CREDIT COMPANY LLC	Finanzsektor	0,81%	USA
Arab Republic of Egypt	Staatsanleihen	0,76%	Ägypten
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzsektor	0,72%	Vereinigtes Königreich
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	0,71%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

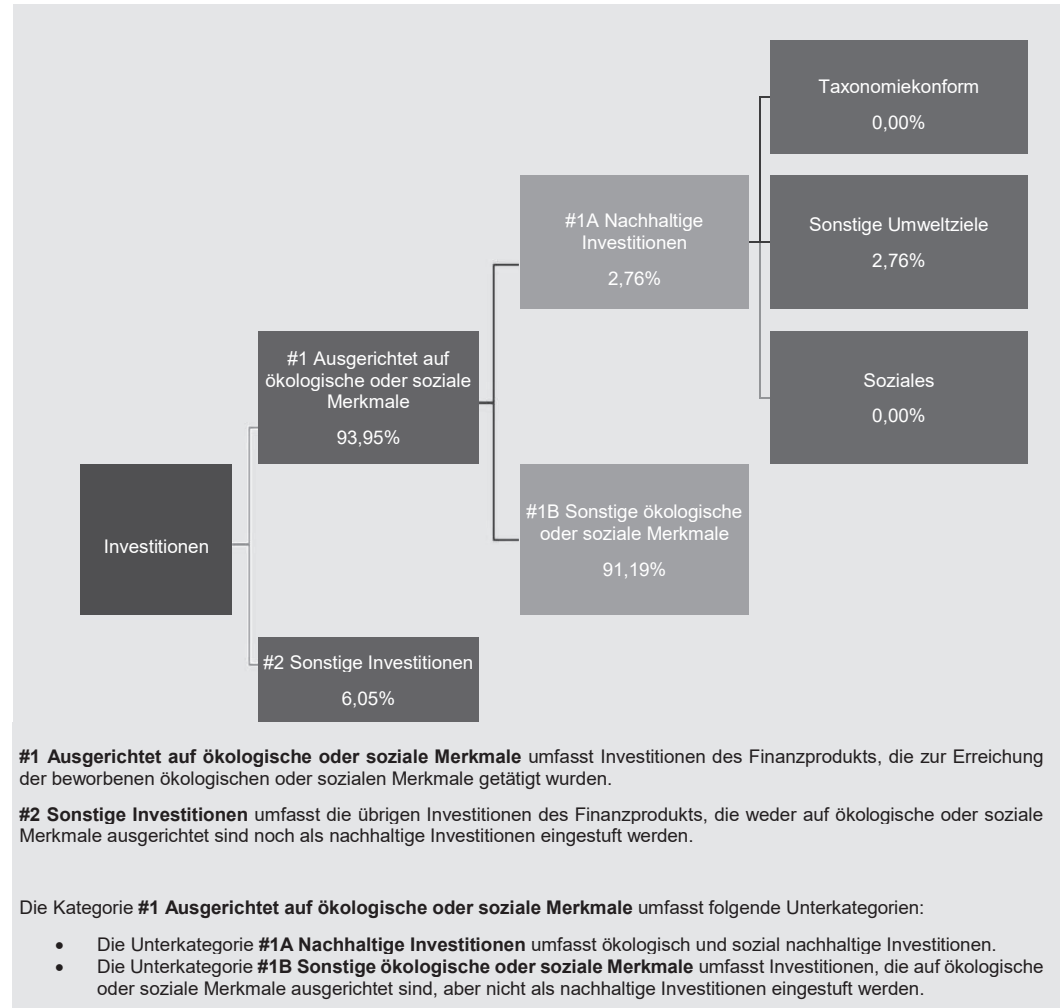
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 2,76 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

93,95 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (6,05 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus vorwiegend 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 2,76 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	93,95%	99,25%	85,60%
#2 Sonstige Investitionen	6,05%	0,75%	14,40%
#1A Nachhaltige Investitionen	2,76%	4,39%	2,20%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	91,19%	94,86%	83,40%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	2,76%	4,39%	2,20%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	39,18%
Finanzsektor	26,36%
Zyklische Konsumgüter	5,78%
Kommunikationsdienste	5,52%
Energie	5,38%
Industrie	4,51%
Grundstoffe	2,27%
Gesundheitssektor	2,08%
Informationstechnologie	1,58%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	39,18%
Finanzdienstleistungen	12,82%
Banken	8,87%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,60%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,73%
Medien	1,90%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	1,74%
Kapitalmärkte	1,54%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	1,33%
Passagierfluggesellschaften	1,26%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,22%
Allgemeiner Einzelhandel	1,14%
Pharmaindustrie	1,13%
Versicherungen	1,07%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	1,06%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

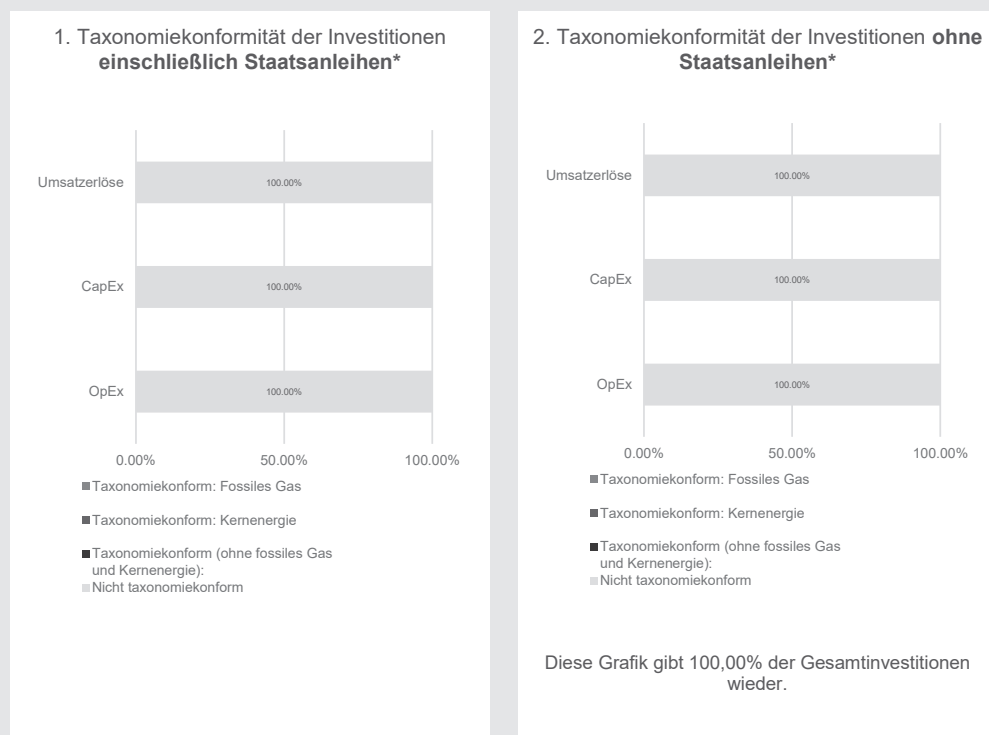
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 2,76 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 6,05 % 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:

- 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“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Fondsportfolios 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).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 2,76 % 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 73,3 % der Proxy-Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 26,6 %.
- D. Der Fonds hatte 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 US High Yield Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493005YY2WWVLYH2080



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,03% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10),
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in die investiert wird, 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

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 wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

sozialen Merkmale erreicht werden.

Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab. Hinweis: Im Jahr 2025 hielt dieser Fonds keine Staatsanleihen mehr.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2025 bei 2,03 %.

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	160,65	71,00%	189,05	75,09%	230,20	72,90%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	0,00	0,00%	166,84	100,00%	175,30	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	71,46%	0,00%	73,78%	0,00%	72,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	68,58%	0,00%	73,78%	0,00%	73,00%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	0,00%	0,00	100,00%	0,00	100,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % des Marktwerts in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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.

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

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 wie u. a. 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 Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ 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 verpflichtenden 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-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
CCO HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,79%	USA
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS, INC.	Gesundheitssektor	1,65%	USA
CSC HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,55%	USA
DISH DBS Corporation	Kommunikationsdienste	1,53%	USA
NCL CORPORATION LTD.	Zyklische Konsumgüter	1,53%	USA
FIRST QUANTUM MINERALS LTD.	Grundstoffe	1,49%	Kanada
Carnival Corporation	Zyklische Konsumgüter	1,19%	USA
Venture Global LNG	Energie	1,15%	USA
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	1,12%	Frankreich
Venture Global Calcasieu	Versorgungsunternehmen	1,02%	USA
PERMIAN RESOURCES OPERATING, LLC	Energie	1,02%	USA
VIKING CRUISES LTD	Zyklische Konsumgüter	1,01%	USA
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Zyklische Konsumgüter	0,99%	USA
BOMBARDIER INC.	Industrie	0,97%	Kanada
UPBOUND GROUP, INC.	Zyklische Konsumgüter	0,94%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

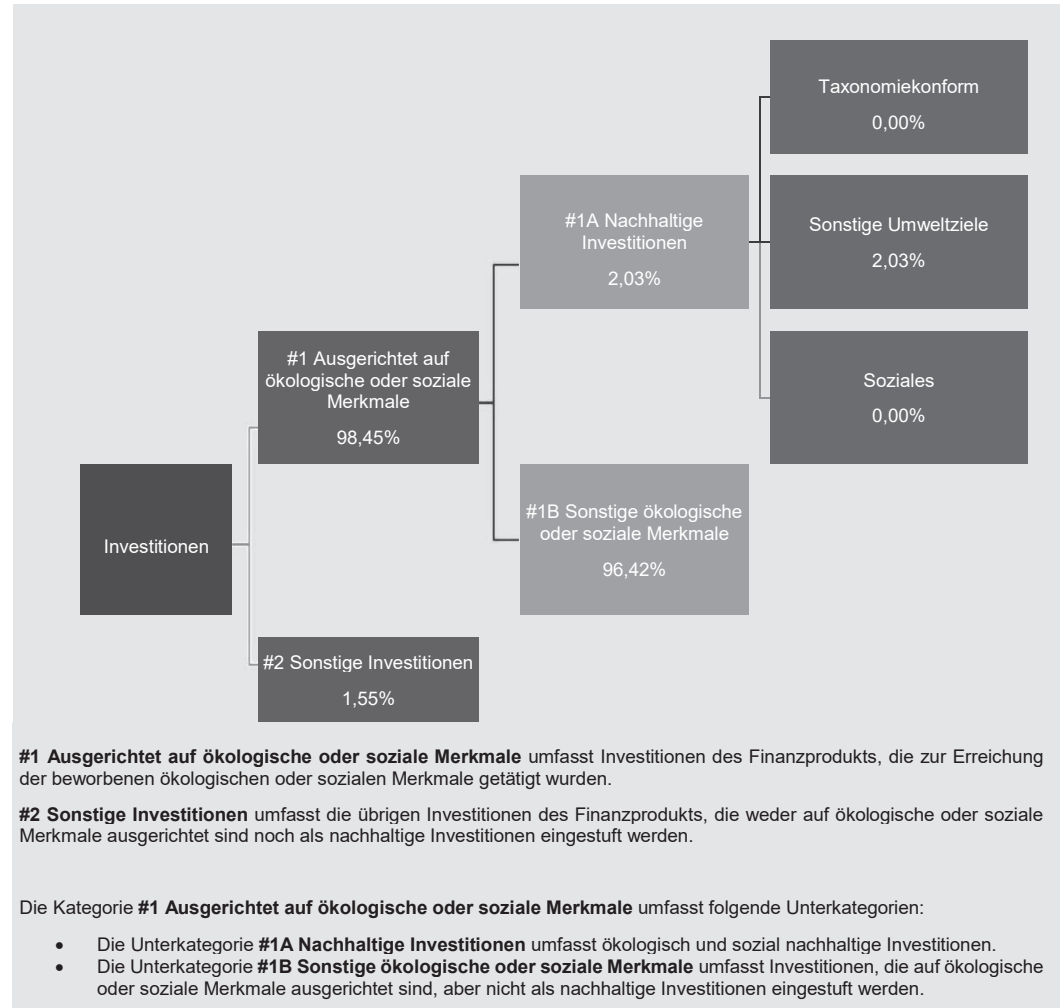
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 2,03 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,45 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,55 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend 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 2,03 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,45%	91,20%	89,00%
#2 Sonstige Investitionen	1,55%	8,80%	11,00%
#1A Nachhaltige Investitionen	2,03%	3,08%	5,30%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	96,42%	88,12%	83,70%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	2,03%	3,08%	5,30%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	27,04%
Zyklische Konsumgüter	17,71%
Industrie	13,72%
Kommunikationsdienste	11,17%
Gesundheitssektor	7,89%
Energie	7,00%
Informationstechnologie	4,40%
Grundstoffe	2,95%
Immobilien	2,75%
Versorgungsunternehmen	2,12%
Basiskonsumgüter	1,30%
Staatsanleihen	0,40%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	15,95%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	8,47%
Medien	8,17%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,47%
Banken	6,29%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,87%
Fahrzeugkomponenten	3,16%
Fachhandel	2,83%
Pharmaindustrie	2,71%
Passagierfluggesellschaften	2,60%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,20%
Kapitalmärkte	2,01%
Software	1,96%
Baustoffe	1,85%
Raumfahrt und Verteidigung	1,72%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



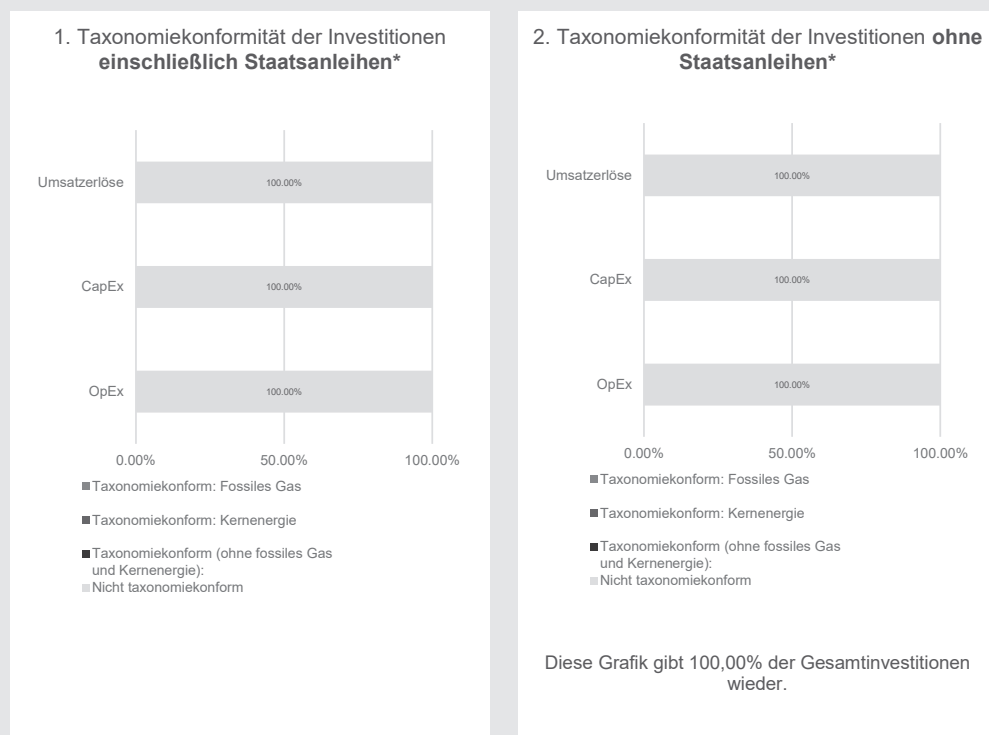
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 2,03 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,55 % und umfasste liquide Mittel und Derivate oder andere Emittenten ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



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 („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- B. 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 SDGs beitrugen.
- 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 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 2,03 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 68,9 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 38,3 %.
- C. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 2,03 % 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?

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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 4,07% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - 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

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 wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2025 bei 4,07 %.

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	160,71	77,00%	213,05	63,38%	287,10	83,60%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	166,48	100,00%	176,32	100,00%	221,40	95,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	17,84%	0,00%	64,11%	0,02%	82,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	63,37%	0,00%	64,11%	0,00%	83,00%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● 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 Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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.

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 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 wie u. a. 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 Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ 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 verpflichtenden PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Konkret kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Grundsätze und die 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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 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.



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Türkiye Cumhuriyeti	Staatsanleihen	2,01%	Türkei
Republica Argentina	Staatsanleihen	1,64%	Argentinien
Gobierno de la Republica Dominicana	Staatsanleihen	1,45%	Dominikanische Republik
T-MOBILE USA, INC.	Kommunikationsdienste	1,45%	USA
CSC HOLDINGS, LLC	Kommunikationsdienste	1,39%	USA
Arab Republic of Egypt	Staatsanleihen	1,37%	Ägypten
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III B.V.	Gesundheitssektor	1,33%	Niederlande
Federal Republic of Nigeria	Staatsanleihen	1,33%	Nigeria
ALTICE FINANCING S.A.	Kommunikationsdienste	1,31%	Luxemburg
Province of Buenos Aires	Staatsanleihen	1,30%	Argentinien
INTESA SANPAOLO SPA	Finanzsektor	1,29%	Italien
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD.	Zyklische Konsumgüter	1,28%	USA
ZF NORTH AMERICA CAPITAL, INC.	Zyklische Konsumgüter	1,19%	Deutschland
BANCO MERCANTIL DEL NORTE S.A.	Finanzsektor	1,17%	Kaimaninseln
MARSTON'S PLC	Finanzsektor	1,16%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

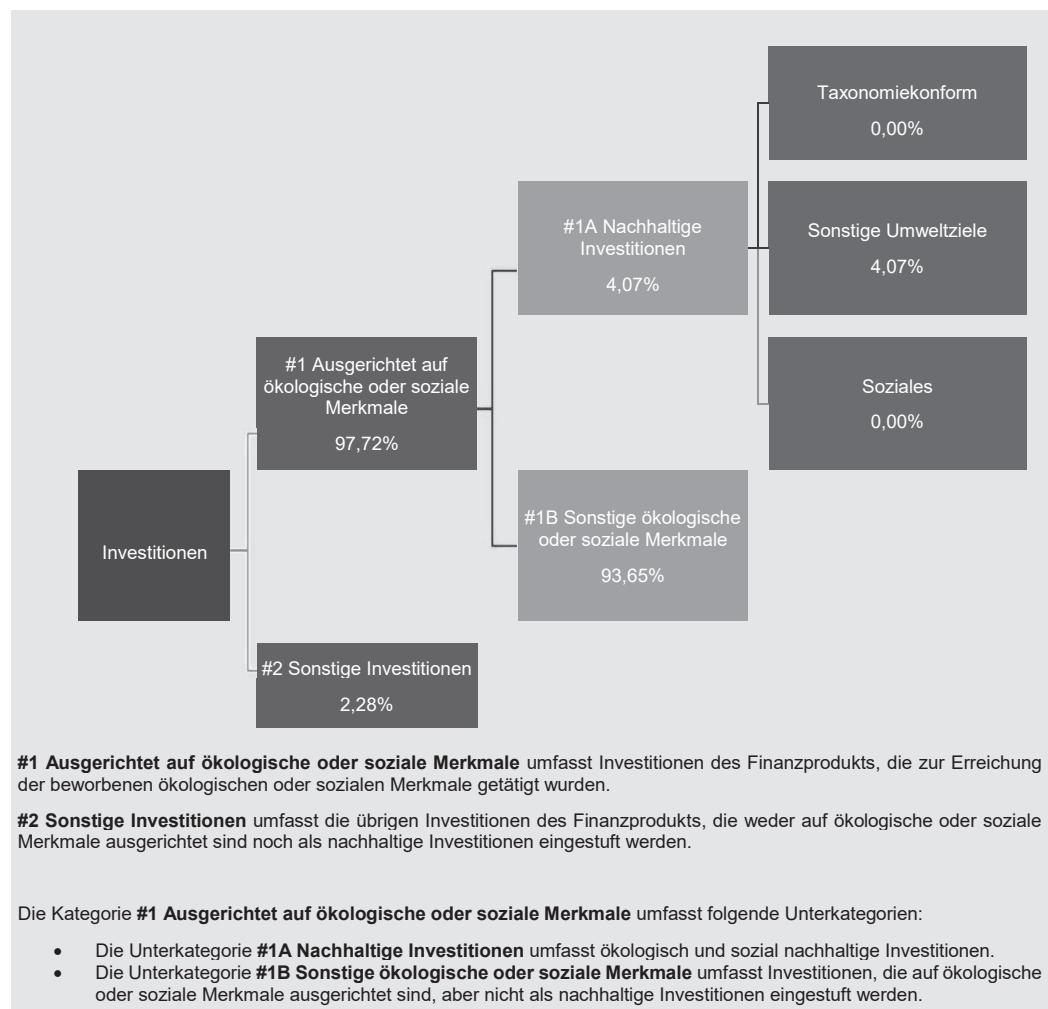
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 4,07 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,72 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,28 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend 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 4,07 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,72%	98,66%	85,60%
#2 Sonstige Investitionen	2,28%	1,34%	14,40%
#1A Nachhaltige Investitionen	4,07%	7,74%	6,90%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	93,65%	90,92%	78,70%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	4,07%	7,74%	6,90%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	18,84%
Zyklische Konsumgüter	17,59%
Finanzsektor	15,62%
Kommunikationsdienste	13,51%
Industrie	12,75%
Gesundheitssektor	4,35%
Grundstoffe	4,33%
Energie	3,67%
Informationstechnologie	3,15%
Basiskonsumgüter	1,76%
Immobilien	1,17%
Versorgungsunternehmen	0,97%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	18,84%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	9,13%
Finanzdienstleistungen	8,72%
Medien	7,89%
Banken	4,62%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	3,65%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,05%
Fahrzeugkomponenten	2,93%
Passagierfluggesellschaften	2,79%
Behälter u. Verpackungen	2,73%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	2,66%
Allgemeiner Einzelhandel	1,95%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,79%
Pharmaindustrie	1,72%
Software	1,67%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



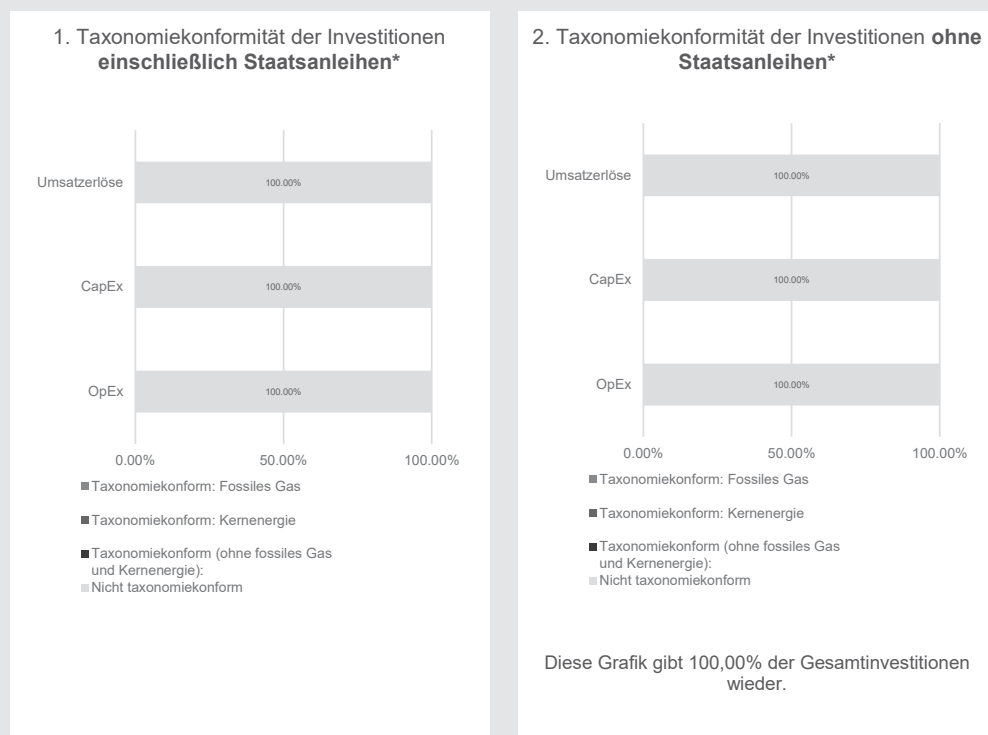
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.

 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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 4,07 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,28 % 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:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Nettovermögens in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDGs beitrugen.

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).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 4,07 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 63,8 % der Benchmark.

C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 36,1 %.

C. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 4,07 % in nachhaltige Anlagen investiert.

D. Gemäß den Definitionen von Western Asset für den 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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 9,44% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10),
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in die investiert wird, 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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen 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 28. Februar 2025 bei 9,44 %.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	736,53	94,93%	64,03	90,31%	63,20	94,60%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	192,53	0,14%	200,01	100,00%	247,50	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,52%	0,00%	89,84%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	93,29%	0,00%	90,09%	0,00%	95,00%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	0,14%	0,00	100,00%	0,00	100,00%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● 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 Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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.

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

● 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 wie u. a. 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 Fonds, 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 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-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	2,54%	USA
Banco Santander, S.A.	Finanzsektor	1,84%	Spanien
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	1,80%	Frankreich
Nationwide Building Society	Finanzsektor	1,50%	Vereinigtes Königreich
MORGAN STANLEY	Finanzsektor	1,44%	USA
DNB BANK ASA	Finanzsektor	1,42%	Norwegen
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	1,41%	USA
Coöperatieve Rabobank U.A.	Finanzsektor	1,35%	Niederlande
ECOLAB INC.	Grundstoffe	1,33%	USA
Pfizer Investment Enterprises Pte. Ltd.	Gesundheitssektor	1,28%	Singapur
ABN AMRO Bank N.V.	Finanzsektor	1,24%	Niederlande
THE GOLDMAN SACHS GROUP, INC.	Finanzsektor	1,24%	USA
NATWEST MARKETS PLC	Finanzsektor	1,23%	Vereinigtes Königreich
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	1,18%	USA
SCHNEIDER ELECTRIC SE	Industrie	1,18%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

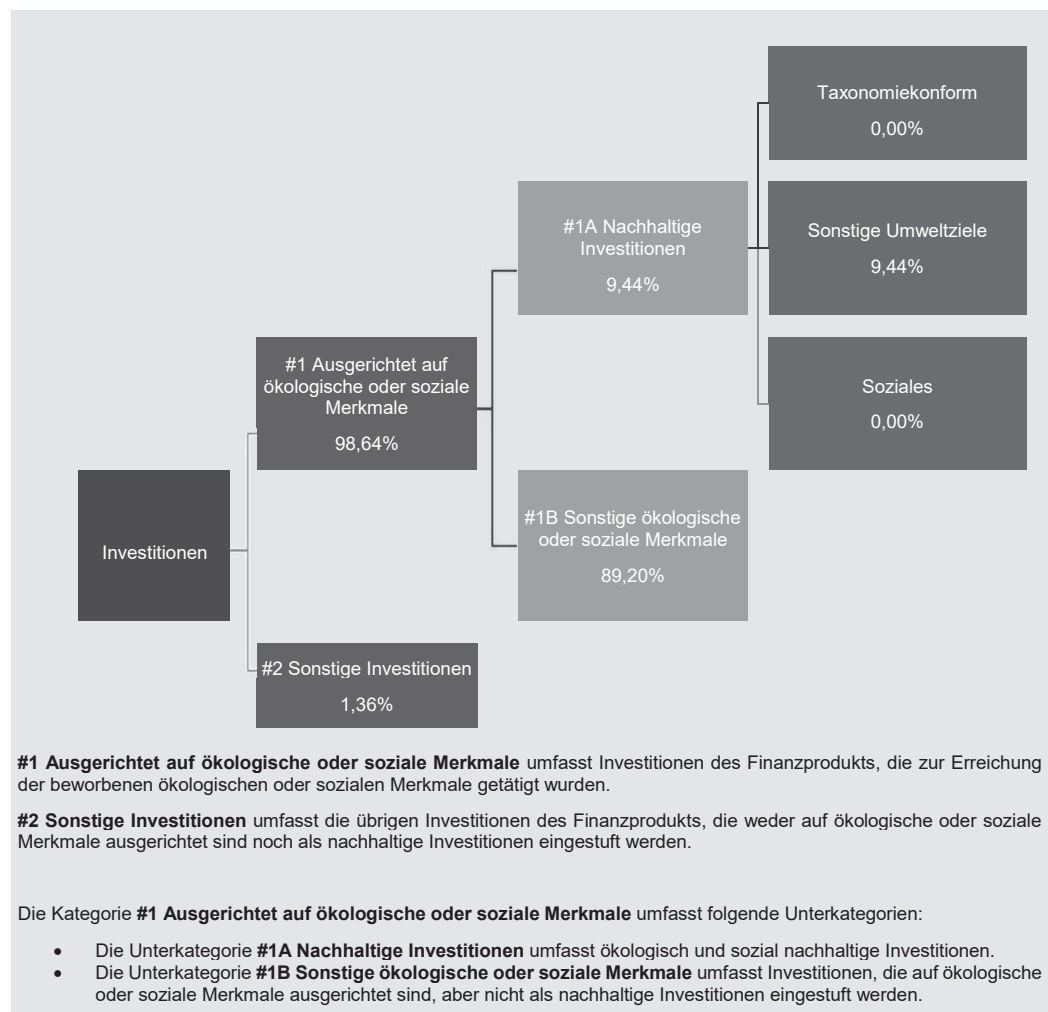
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 9,44 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,64 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,36 %) 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 9,44 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,64%	99,99%	93,50%
#2 Sonstige Investitionen	1,36%	0,01%	6,50%
#1A Nachhaltige Investitionen	9,44%	15,65%	12,30%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	89,20%	84,34%	81,20%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	9,44%	15,65%	12,30%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	42,07%
Industrie	12,61%
Gesundheitssektor	12,18%
Basiskonsumgüter	9,42%
Immobilien	5,05%
Versorgungsunternehmen	4,37%
Zyklische Konsumgüter	3,78%
Informationstechnologie	2,59%
Energie	2,46%
Kommunikationsdienste	2,05%
Grundstoffe	1,91%
Staatsanleihen	0,14%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Banken	20,54%
Finanzdienstleistungen	9,38%
Pharmaindustrie	9,02%
Kapitalmärkte	5,10%
Stromversorger	4,15%
Getränke	3,63%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	2,80%
Maschinen	2,56%
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	2,30%
Versicherungen	2,17%
Bau- u. Ingenieurwesen	2,12%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,08%
Verkehrsinfrastruktur	2,00%
Elektrogeräte	1,92%
Chemische Erzeugnisse	1,91%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



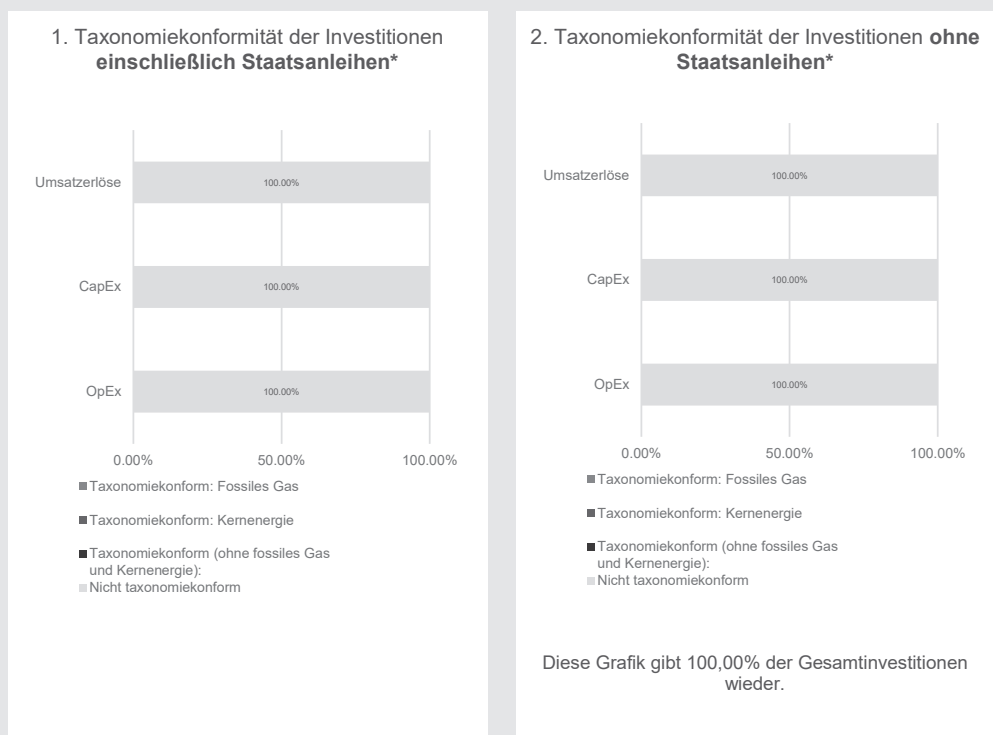
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 9,44 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 1,36 % 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 ökologischen 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“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Fondsportfolios 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 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 9,44 % 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 A.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 30,9 % der Proxy-Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag per 28. Februar 2025 bei 84,2 % des Marktwerts.
- D. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.
- E. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums.



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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1,23% 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
- ☐ Es wurden damit 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“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - 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

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 nachstehenden Werte – sie bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.

sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2025 bei 1,23 %.

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	322,38	38,90%	64,51	30,03%	67,50	88,80%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	311,18	49,50%	197,16	100,00%	231,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	39,01%	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	38,56%	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. 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 wie u. a. 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 Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ 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).

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?

Die Anlageverwaltung hat ein eigenes PAI-Tool entwickelt, das sämtliche verpflichtenden PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die 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 Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien 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, welche 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
United States of America	Finanzsektor	10,53%	USA
Bundesrepublik Deutschland	Staatsanleihen	9,36%	Deutschland
FRANKLIN RESOURCES, INC.	Finanzsektor	8,41%	USA
Federal National Mortgage Association	Finanzsektor	8,25%	USA
Japan	Staatsanleihen	7,54%	Japan
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	Staatsanleihen	4,86%	Vereinigtes Königreich
Estados Unidos Mexicanos	Staatsanleihen	2,47%	Mexiko



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

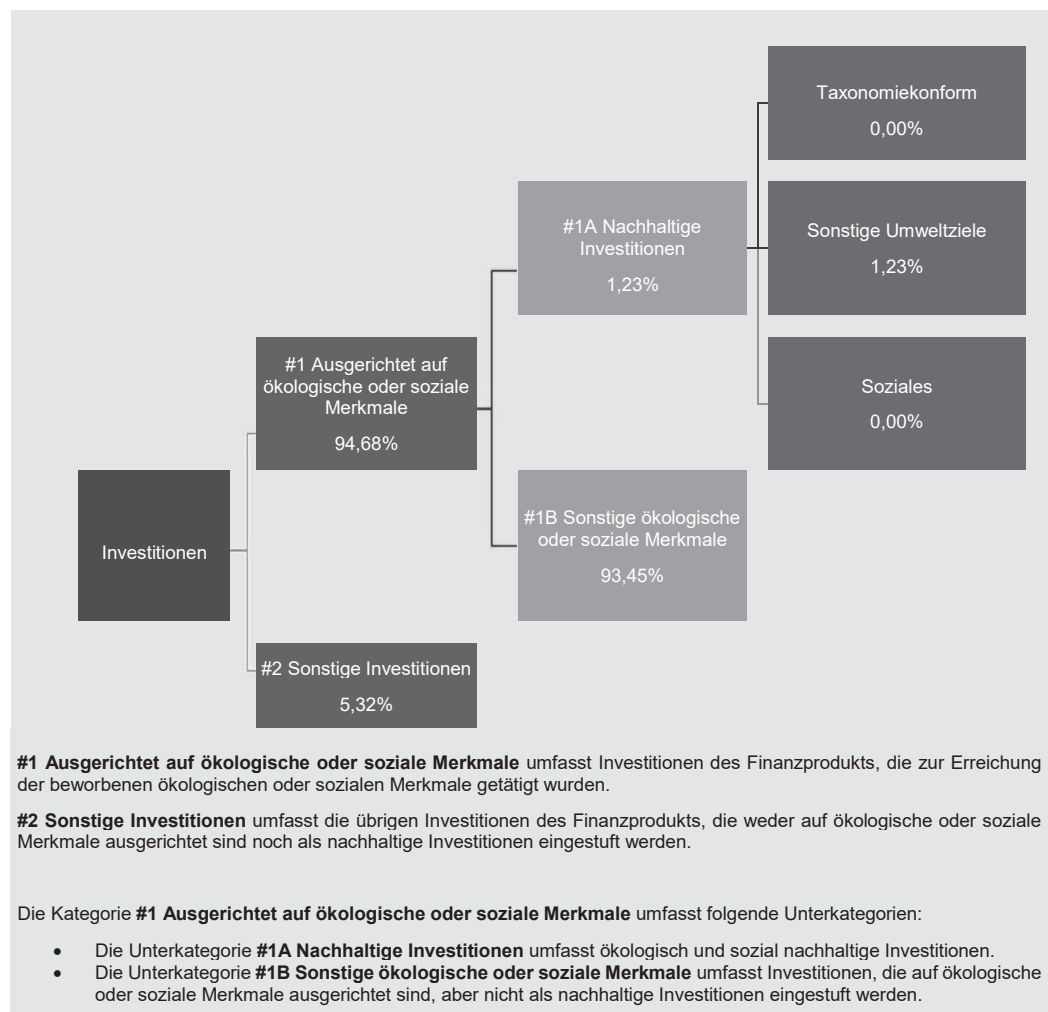
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 1,23 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,68 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,32 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend 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 1,23 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	94,68%	100,00%	90,50%
#2 Sonstige Investitionen	5,32%	K. A.	9,50%
#1A Nachhaltige Investitionen	1,23%	3,71%	1,60%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	93,45%	96,29%	88,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	1,23%	3,71%	1,60%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	46,43%
Finanzsektor	37,56%
Kommunikationsdienste	3,29%
Gesundheitssektor	2,18%
Immobilien	1,61%
Energie	1,43%
Zyklische Konsumgüter	0,93%
Basiskonsumgüter	0,52%
Grundstoffe	0,27%
Industrie	0,26%
Informationstechnologie	0,16%
Versorgungsunternehmen	0,04%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	46,43%
Finanzdienstleistungen	23,78%
Banken	8,89%
Kapitalmärkte	2,21%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	1,43%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,39%
Medien	1,37%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,18%
Versicherungen	1,00%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,99%
Diversifizierte Banken	0,75%
Pharmaindustrie	0,63%
Mortgage Real Estate Investment Trusts (REITs)	0,51%
Unterhaltung	0,49%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	0,44%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

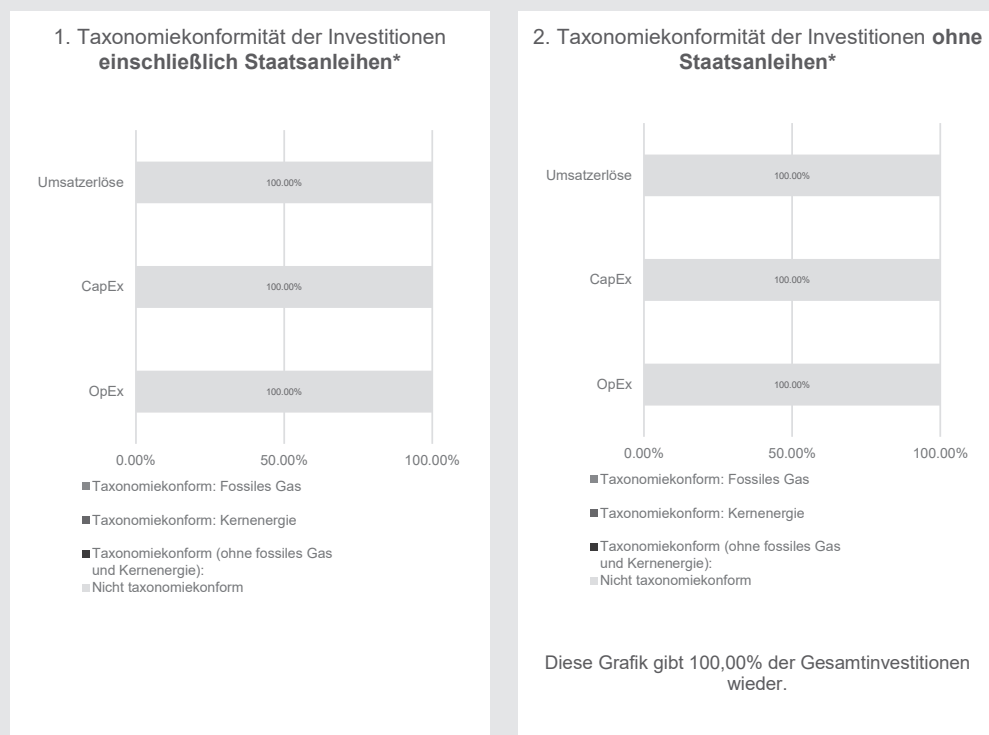
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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, das laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 1,23 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



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 der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 5,32 % 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:

- 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“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines NIW in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schließt Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstoßen, 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 28. Februar 2025 gemessen am prozentualen Marktwert 1,23 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von **BBB**.
- B. Der WACI des Fonds lag bei 77,3 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 22,5 %.
- E. Gemäß den Definitionen von Western Asset für den 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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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="radio"/> JA	<input checked="" type="radio"/> NEIN
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt : 0,00%	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% 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 type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt : 0,00%	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit 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 ökologische und soziale Merkmale und wendete dabei mehrere Ansätze an, die miteinander verknüpft sind. Jedes Land wurde unter Verwendung der ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung bewertet, bei der über 60 Eingabekriterien berücksichtigt werden („60+ Input ESG-Bewertungsmethode“). Dabei wurden die Merkmale in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung untersucht. Zu diesen Merkmalen zählten unter anderem die Bewertung der klimabedingten physischen und Übergangsrisiken, der Umweltschutzmaßnahmen und der Abfallwirtschaft, der Arbeitnehmerrechte, der Aus- und Weiterbildung, der individuellen und institutionellen Freiheit, der Frauen- und Kinderrechte und deren Schutzes, der Kriminalität und der Korruption. Möglicherweise wurden mitunter noch weitere Merkmale untersucht, die die ungeschränkte Strategie des Fonds widerspiegeln. Mit der „60+ Input ESG-Bewertungsmethode“ der Anlageverwaltung wurden Scores und Rankings für Portfolios und investierbare Anlageuniversen erstellt, wobei Emittenten, die zu den schwächsten 10 % zählten, von der Betrachtung ausgeschlossen wurden. Diese Scores waren auch dafür ausschlaggebend, um wichtige Engagement-Themen mit den Emittenten im zweittiefsten Dezil (80. bis 90. Perzentil) anzugehen. Behandelt wurde unter anderem auch das Thema der Treibhausgasemissionen, ein verpflichtender staatlicher PAI-Indikator. Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

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: Mexiko.

B. Nachverfolgung der relevanten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), wie z. B. des PAI Nr. 15 (THG-Intensität).

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	265,31	95,03%	386,70	83,31%	488,87	86,14%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

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: Republik Südafrika
- Laufende Periode: Mexiko

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.

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?

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.

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, welche 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 dienten. 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
US TREASURY N/B	Staatsanleihen	35,54%	USA
US TREASURY FRN	Staatsanleihen	32,66%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

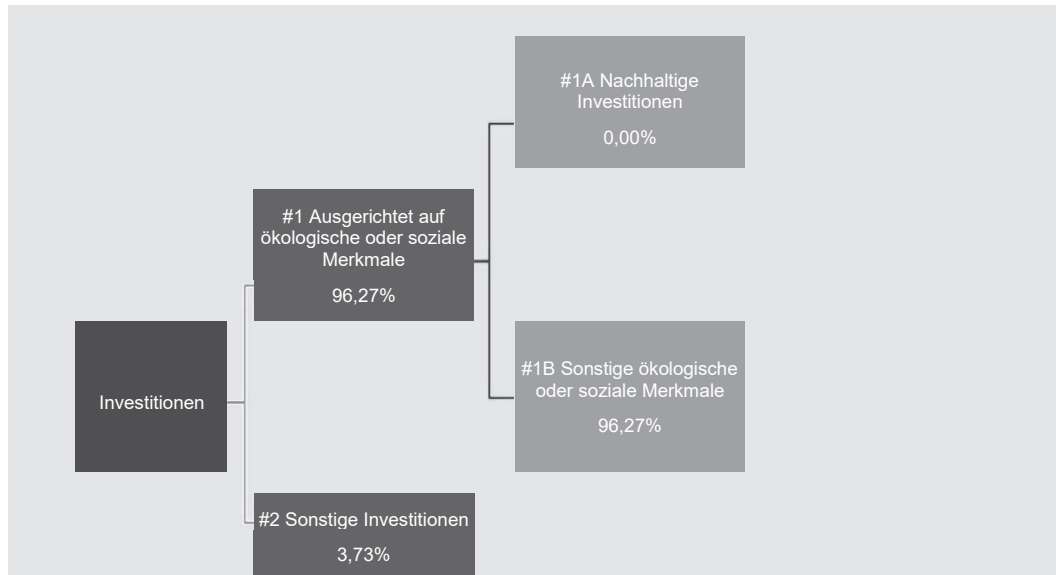
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,27 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,73 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend 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 Sonstige 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 Sonstige ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,27%	97,46%	97,43%
#2 Sonstige Investitionen	3,73%	2,54%	2,57%
#1A Nachhaltige Investitionen	K. A.	K. A.	K. A.
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	96,27%	97,46%	97,43%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	K. A.	K. A.	K. A.
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● ***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	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	96,27%
Wichtigster Teilssektor	In % der Vermögenswerte
Staatsanleihen	96,27%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



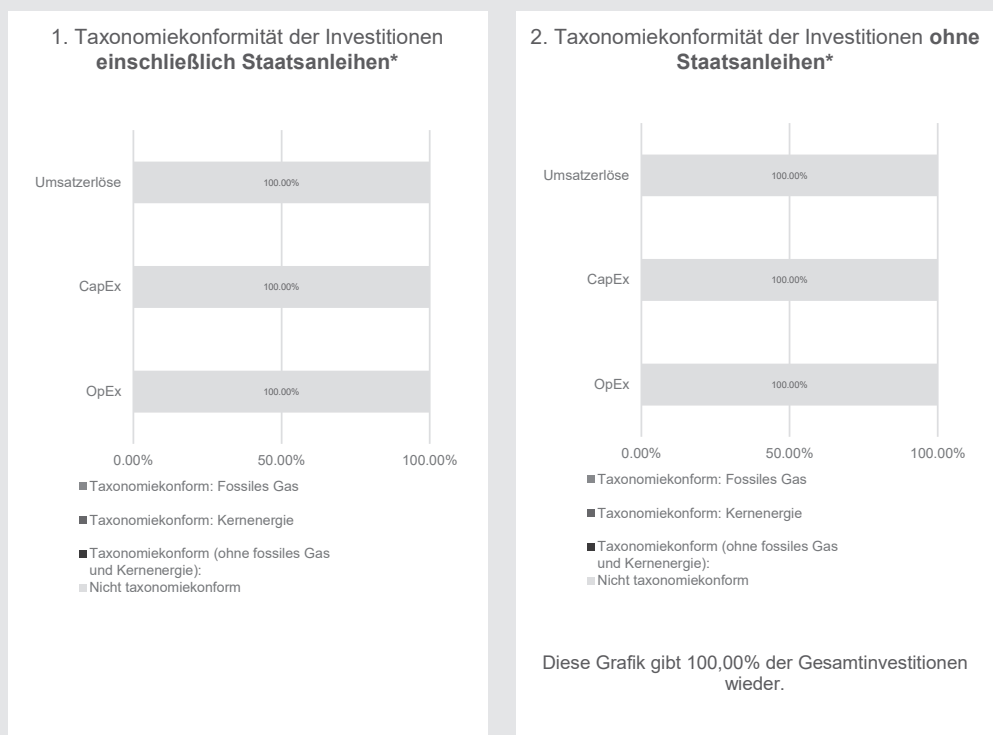
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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?

0 % der Fondsinvestitionen waren nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds investierte 0 % in sozial nachhaltige Anlagen.



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 3,73 % 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: Mexiko
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.



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 4,78% 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
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Im Hinblick auf staatliche Emittenten umfasste der ESG-Analyserahmen ein breites Spektrum an ESG-Faktoren. Dabei wurden die Faktoren der „60+ Input Score-Bewertungsmethode“ sowie unter anderem die folgenden Faktoren berücksichtigt: Entwaldung und Landnutzung/Flächenschutz, Anfälligkeit für den Klimawandel, Treibhausgasemissionen insgesamt, Abhängigkeit von der Ausfuhr fossiler Brennstoffe, Wasserverbrauch, zivile und politische Rechte, Überwachung und Regulierung der Privatwirtschaft, insbesondere im Hinblick auf Sicherheit. Bei Emittenten, bei denen es sich um Unternehmen handelte, beurteilte die Anlageverwaltung ökologische und soziale Aspekte, zu denen unter anderem die folgenden zählten: Kohlenstoffemissionen und Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und -bewahrung.

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

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

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. Der Fonds schloss Anlagewerte, die sich im schwächsten Dezil befanden, aus. Im Berichtszeitraum gab es keine Emittenten im schwächsten Dezil.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Allegiant Travel Co, Arab Republic of Egypt, Civitas Resources Inc, Codelco Inc, Ero Copper Corp, Minerva Luxembourg SA, Mohegan Tribal Gaming AU, Nota do Tesouro Nacional, RenaissanceRe Holdings Ltd.

B. Nachverfolgung der relevanten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), wie z. B. des PAI Nr. 15. Bitte beachten Sie die nachstehenden Werte.

C. Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen mit 4,78 % und die Verwendung der Anleiherträge durch die Emittenten, vor allem die Ertragsverwendung bei grünen, sozialen, nachhaltigen oder Übergangs-Anleihen, die die Verpflichtung des Fonds zu nachhaltigen Anlagen in Prozent des Nettovermögens erfüllen. Dazu gehören unter anderem:

- Saubere und erschwingliche Energie (Solarenergie und Biokraftstoffe)
- Saubere Mobilität
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Umweltverträgliches Bauen
- Nachhaltige Städte und Gemeinden

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	444,89	18,71%	437,25	24,40%	481,49	10,54%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

Vorherige Periode: World Acceptance Corp.

Laufende Periode: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Emittenten im schwächsten Dezil befanden.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

Vorherige 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.

Laufende Periode: Allegiant Travel Co, Arab Republic of Egypt, Civitas Resources Inc, Codelco Inc, Ero Copper Corp, Minerva Luxembourg SA, Mohegan Tribal Gaming AU, Nota do Tesouro Nacional, RenaissanceRe Holdings Ltd.

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen

Vorherige 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

Laufende Periode: 4,78 %. 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 und erschwingliche Energie (Solarenergie und Biokraftstoffe)
- Saubere Mobilität
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Umweltverträgliches Bauen
- Nachhaltige Städte und Gemeinden

● **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 4.78 % 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:

- Saubere und erschwingliche Energie (Solarenergie und Biokraftstoffe)
- Saubere Mobilität
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Umweltverträgliches Bauen
- Nachhaltige Städte und Gemeinden

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?**

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 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.

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, welche 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 Schwellenwerte für das Prinzip „keine erheblichen Beeinträchtigungen“ 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MEXICAN BONOS 7.5% 05/26/33	Staatsanleihen	3,31%	Mexiko
UK TSY GILT 3.75% 10/22/53	Staatsanleihen	3,28%	Vereinigtes Königreich
MEXICAN BONOS 8% 07/31/53	Staatsanleihen	1,83%	Mexiko
STACR 2022-DNA5 M2 FLT 06/25/42 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,57%	USA
COLOMBIA TES 7% 03/26/31	Staatsanleihen	1,45%	Kolumbien
STACR 2022-DNA4 M2 FLT 05/25/42 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,40%	USA
GRAHAM PKG CO IN 7.125% 08/15/28 144A	Unternehmensanleihen	1,33%	USA
STACR 2018-HQA2 M2B FLT 10/25/48 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,33%	USA
CAS 2020-SBT1 2M2 FLT 02/25/40 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,30%	USA
CAS 2020-SBT1 1M2 FLT 02/25/40 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,24%	USA
PANAMA 3.87% 07/23/60	Staatsanleihen	1,19%	Panama
BLUE OWL TECHNOL 3.75% 06/17/26 144A	Unternehmensanleihen	1,15%	USA
PANAMA 4.5% 01/19/63	Staatsanleihen	1,12%	Panama
MOHEGAN TRIBAL 8% 02/01/26 144A	Unternehmensanleihen	1,11%	USA
BAYTEX ENERGY 8.5% 04/30/30 144A	Unternehmensanleihen	1,04%	Kanada



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

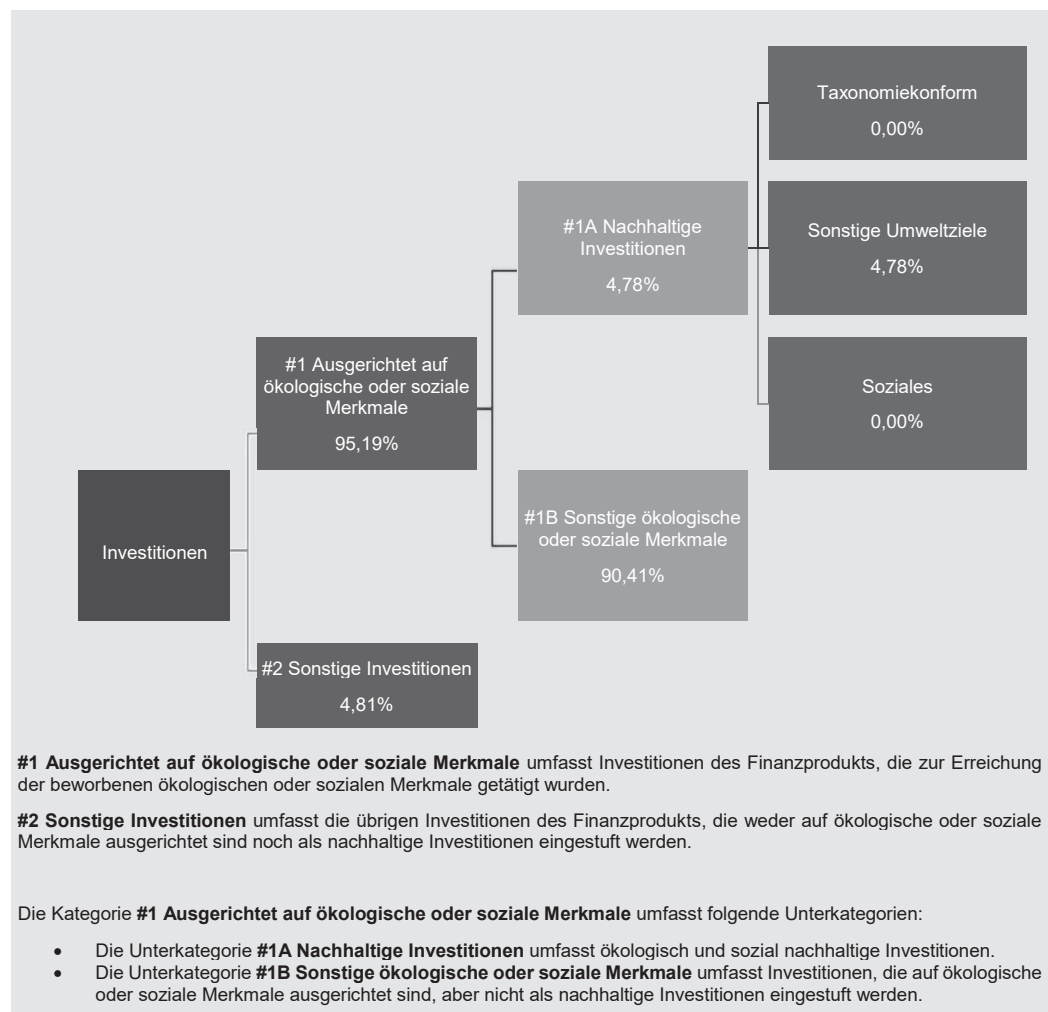
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 4,78 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,19 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (4,81 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 4,78 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	95,19%	96,07%	93,75%
#2 Sonstige Investitionen	4,81%	3,93%	6,25%
#1A Nachhaltige Investitionen	4,78%	5,52%	1,18%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	90,41%	90,55%	92,57%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	4,78%	5,52%	1,18%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	19,95%
Staatsanleihen	19,54%
Hypothekensanleihen	15,92%
Energie	15,50%
Zyklische Konsumgüter	8,46%
Grundstoffe	6,99%
Kommunikation	6,46%
Industrie	3,86%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,95%
Forderungsbekundete Wertpapiere	0,50%
Versorgungsunternehmen	0,46%
Technologie	0,41%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Staatlich	17,58%
WL-bekundete CMO	15,92%
Öl & Gas	9,35%
Diversifizierte Finanzdienste	9,21%
Investmentunternehmen	5,96%
Pipelines	5,63%
Telekommunikation	4,24%
Banken	3,84%
Bergbau	3,09%
Fluggesellschaften	3,07%
Eisen/Stahl	2,60%
Unterhaltung	2,46%
Multinationale Unternehmen	1,96%
Medien	1,47%
Einzelhandel	1,35%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



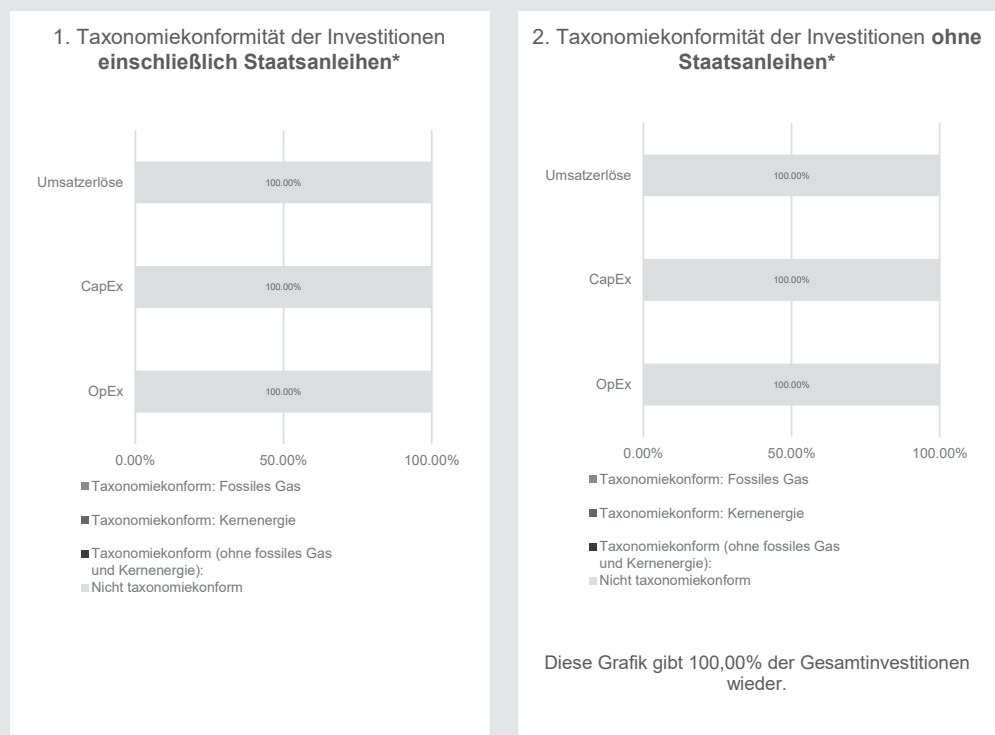
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 einen Anteil von 4,78 % auf.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil an Investitionen mit einem sozialen Ziel von 0 % auf.



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 4,81 % 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. Der Fonds schloss Anlagewerte, die sich im schwächsten Dezil befanden, aus. Im Berichtszeitraum gab es keine Emittenten im schwächsten Dezil.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweittiefsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Allegiant Travel Co, Arab Republic of Egypt, Civitas Resources Inc, Codelco Inc, Ero Copper Corp, Minerva Luxembourg SA, Mohegan Tribal Gaming AU, Nota do Tesouro Nacional, RenaissanceRe Holdings Ltd.
3. Bis zu 90 % 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 mindestens 1 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.
5. Im Hinblick auf die folgenden Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Kraftwerkskohle
- Umstrittenen Waffen, einschließlich Kernwaffen
- Erwachsenenunterhaltung

Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die gemäß dem Global Compact der Vereinten Nationen als „durchgefallen“ bewertet wurden, und auch nicht in staatliche Emittenten, die als Rechtsgebiete mit hohem Risiko gelten oder von den United Nations Security Council Sanctions betroffen sind.



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 ClearBridge US 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 31,88% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

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.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- 31,88 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig

beworbenen
ökologischen oder
sozialen Merkmale
erreicht werden.

- angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- Alle Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI), die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung sind, insbesondere PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
 - Abstimmung über 910 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden
 - Der Prozentsatz des Portfolios mit einem B-Rating laut unternehmenseigenem ESG-Ratingsystem der Anlageverwaltung lag bei 1,2 %.
 - unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
 - Der Fonds fällt in den Geltungsbereich des Netto-Null-Ziels von ClearBridge und wurde daher anhand des Anteils der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftsbasierte Ziele zur Reduktion von Treibhausgasemissionen gesetzt haben, sich zu solchen verpflichtet haben oder Klimaschutzlösungen anbieten: 33,32 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	33,32%	34,79%	20,65%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	3,31%	10,25%	16,06%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	900 668,41	96,81%	827 154,39	96,33%	747 211,99	96,45%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	670,42	96,81%	869,81	96,33%	877,12	96,45%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	1 802,98	97,44%	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%	97,68%	0,00%	96,75%	0,00%	98,96%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	34,93%	96,57%	36,65%	92,03%	34,34%	94,40%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,57%	0,00%	92,03%	0,00%	94,40%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **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 Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 16,85 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht: 33,32 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung 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 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 Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	3,02%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,95%	USA
GILEAD SCIENCES, INC.	Gesundheitssektor	2,20%	USA
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Finanzsektor	2,18%	USA
COREBRIDGE FINANCIAL, INC.	Finanzsektor	2,08%	USA
EQT CORPORATION	Energie	2,02%	USA
FISERV, INC.	Finanzsektor	1,99%	USA
MICRON TECHNOLOGY, INC.	Informationstechnologie	1,94%	USA
HESS CORPORATION	Energie	1,89%	USA
FREEMPORT-MCMORAN INC.	Grundstoffe	1,83%	USA
Nestle S.A.	Basiskonsumgüter	1,80%	Schweiz
VISTRA CORP.	Versorgungsunternehmen	1,76%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	1,75%	USA
ORACLE CORPORATION	Informationstechnologie	1,74%	USA
ABBVIE INC.	Gesundheitssektor	1,69%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

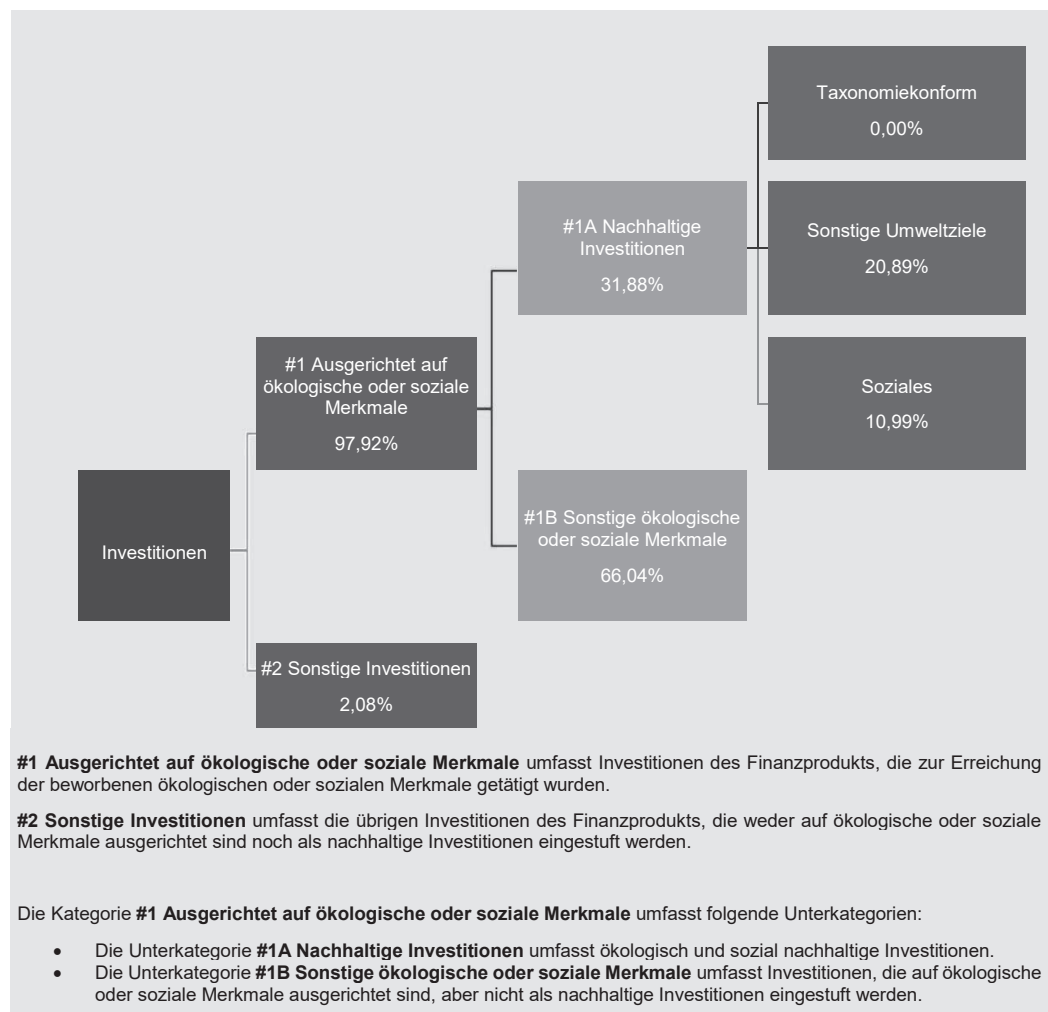
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 31,88 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,92 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,08 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 31,88 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,92%	98,10%	98,96%
#2 Sonstige Investitionen	2,08%	1,90%	1,04%
#1A Nachhaltige Investitionen	31,88%	30,40%	29,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	66,04%	67,70%	69,96%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	20,89%	24,70%	16,00%
Soziales	10,99%	5,70%	13,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	25,00%
Gesundheitssektor	14,20%
Industrie	13,42%
Energie	11,06%
Versorgungsunternehmen	7,97%
Informationstechnologie	7,01%
Basiskonsumgüter	6,38%
Grundstoffe	6,18%
Immobilien	2,63%
Kommunikationsdienste	2,60%
Zyklische Konsumgüter	1,46%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	10,60%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	7,38%
Biotechnologie	5,59%
Banken	5,20%
Pharmaindustrie	4,89%
Stromversorger	4,24%
Versicherungen	3,97%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	3,70%
Energieanlagen und -dienstleistungen	3,68%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,50%
Metalle u. Bergbau	3,29%
Überlandtransport	3,21%
Verbraucherkreditgeschäft	3,02%
Lebensmittel	2,58%
Chemische Erzeugnisse	2,41%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

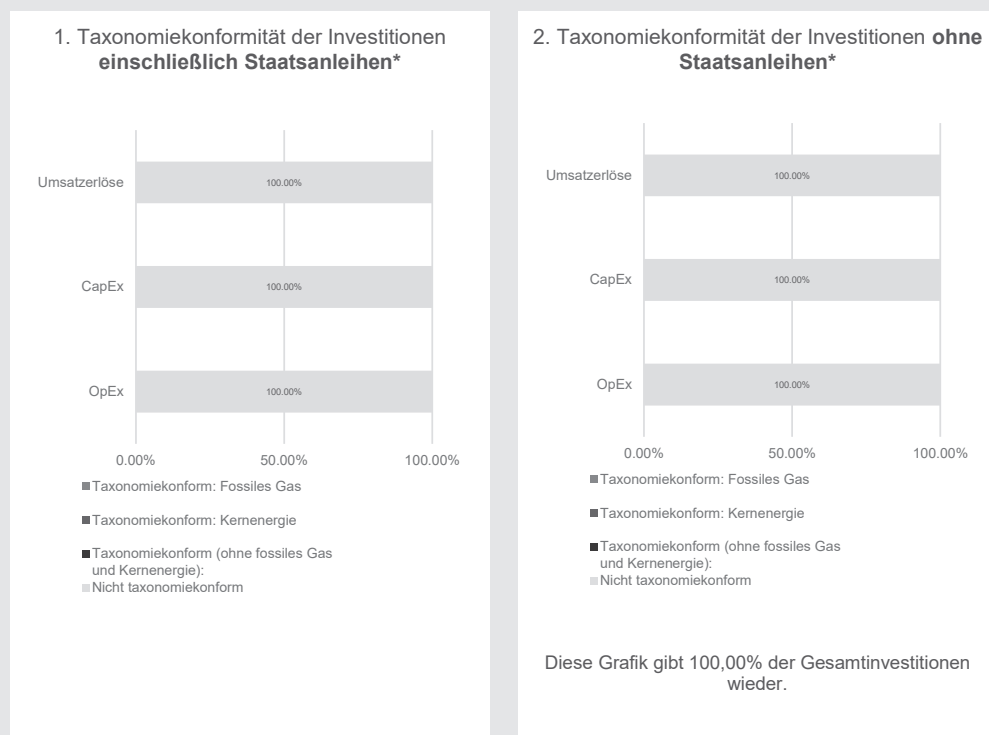
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 20,89 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 10,99 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,08 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 14,4 %

AA: 61,4 %

A: 23,0 %

B: 1,2 %

2. 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.

Darüber hinaus tauschte sich die Anlageverwaltung 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://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
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes direkt aus konventionellen Waffen generieren.

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

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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 58,49% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. 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.

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:

- 58,49 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) – hier 30,69 % – und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in 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?“.
 - unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
 - Abstimmung über 1037 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden,
 - Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:
- AAA: 37,7 %
 - AA: 43,4 %
 - A: 18,9 %
 - B: 0 %

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	38 926,51	98,66%	74 995,36	98,83%	67 906,15	95,72%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	200,37	98,66%	377,30	98,83%	381,67	95,72%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	828,71	98,66%	1 066,81	98,83%	886,78	95,72%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,66%	0,16%	98,83%	0,00%	95,72%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	36,93%	98,66%	36,13%	98,83%	35,65%	95,72%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,66%	0,00%	98,83%	0,00%	95,72%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 30,69 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten: 27,80 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung 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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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).



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	8,02%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	5,75%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	4,40%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	4,31%	USA
BERKSHIRE HATHAWAY INC.	Finanzsektor	3,66%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	3,24%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	2,96%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	2,94%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	2,45%	USA
THE TJX COMPANIES, INC.	Zyklische Konsumgüter	2,40%	USA
ELI LILLY AND COMPANY	Gesundheitssektor	2,37%	USA
The Travelers Companies, Inc.	Finanzsektor	2,13%	USA
BANK OF AMERICA CORPORATION	Finanzsektor	2,08%	USA
AUTOMATIC DATA PROCESSING, INC.	Industrie	1,92%	USA
WASTE MANAGEMENT, INC.	Industrie	1,79%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

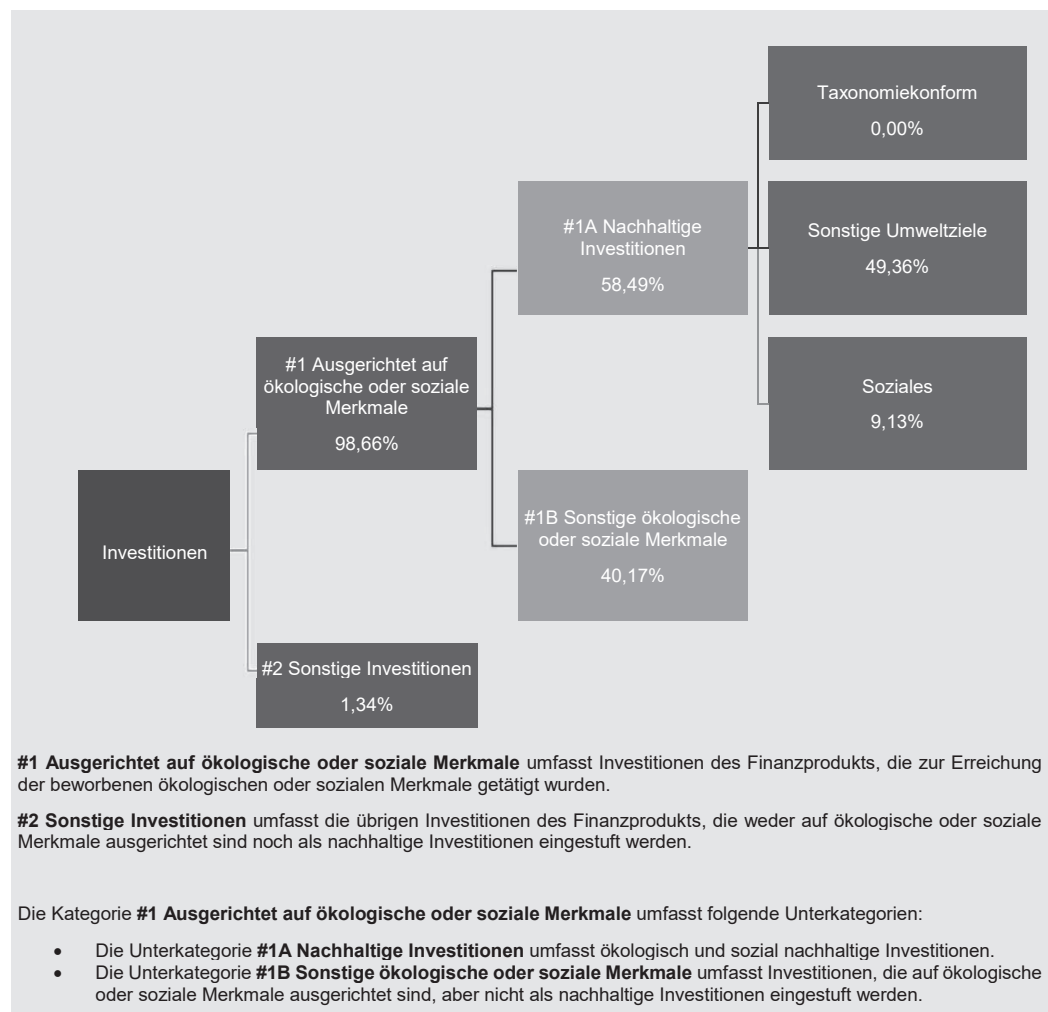
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 58,49 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,66 % des Fondsportfolios waren 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 vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 58,49 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,66%	98,65%	95,72%
#2 Sonstige Investitionen	1,34%	1,35%	4,28%
#1A Nachhaltige Investitionen	58,49%	65,31%	59,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	40,17%	33,34%	36,72%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	49,36%	47,90%	40,00%
Soziales	9,13%	17,41%	19,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	25,77%
Finanzsektor	17,77%
Gesundheitssektor	11,72%
Industrie	10,29%
Kommunikationsdienste	9,33%
Zyklische Konsumgüter	7,48%
Basiskonsumgüter	6,88%
Grundstoffe	5,08%
Energie	1,73%
Versorgungsunternehmen	1,52%
Immobilien	1,08%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Software	11,65%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	7,34%
Finanzdienstleistungen	6,60%
Banken	6,36%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	5,75%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	5,69%
Pharmaindustrie	5,62%
Allgemeiner Einzelhandel	4,40%
Elektrogeräte	3,15%
Chemische Erzeugnisse	3,13%
Versicherungen	3,07%
Fachhandel	2,74%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,60%
Unterhaltung	2,35%
Getränke	2,05%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



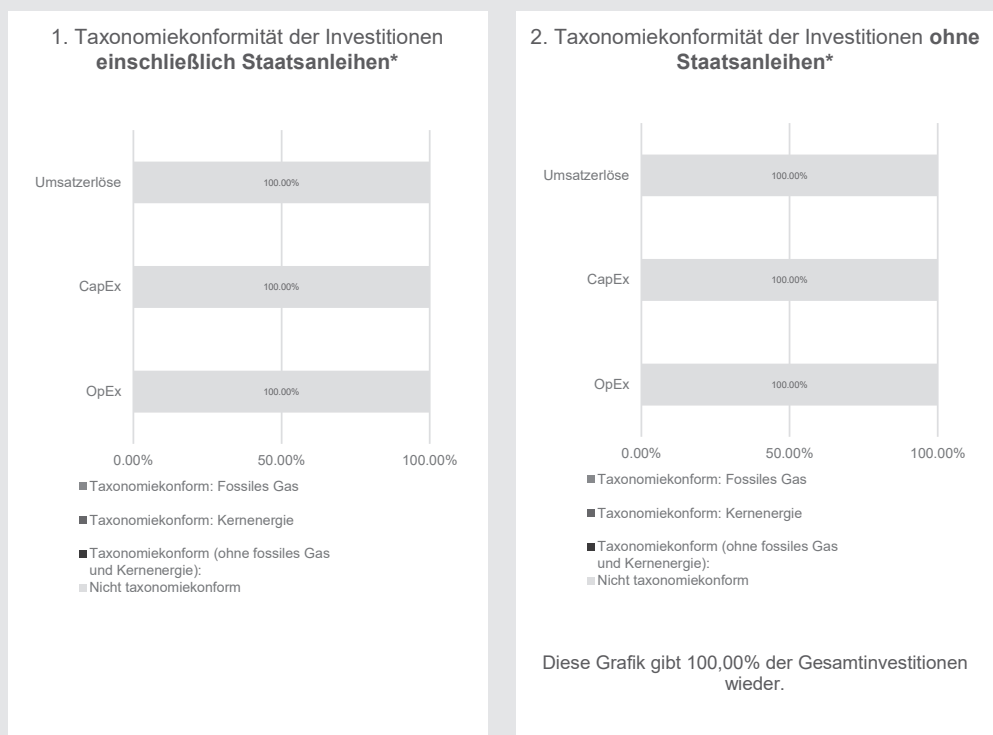
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 49,36 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 9,13 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,34 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 37,7 %

AA: 43,4 %

A: 18,9 %

B: 0 %

2. 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.

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 Branchen 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

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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 70,82% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. 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.

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:

- 70,82 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- Alle nachteiligen Auswirkungen (PAI), nämlich PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-

Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- unternehmenseigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung 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 unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Abstimmung über 614 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden:
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 44,4 %
- AA: 41,3 %
- A: 14,5 %
- B: 0 %

Der Fonds fällt in den Geltungsbereich des Netto-Null-Ziels von ClearBridge und wird daher anhand des Anteils der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftsbasierte Ziele zur Reduktion von Treibhausgasemissionen gesetzt haben, sich zu solchen verpflichtet haben oder Klimaschutzlösungen anbieten: 62,15 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	62,15%	59,73%	44,24%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	5,07%	16,36%	23,62%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	122 842,96	97,44%	151 371,76	97,27%	106 503,87	95,26%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	65,23	97,44%	94,84	97,27%	97,02	95,26%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	287,74	97,44%	379,30	97,27%	465,22	95,26%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,44%	0,00%	97,27%	0,00%	95,26%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	35,24%	97,44%	35,78%	96,64%	34,89%	95,26%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,44%	0,00%	96,64%	0,00%	95,26%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 33,30 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht: 51,92 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung 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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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).



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	8,99%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	7,96%	USA
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	7,43%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	6,14%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	4,80%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	4,76%	USA
NETFLIX, INC.	Kommunikationsdienste	3,74%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	2,83%	USA
PALO ALTO NETWORKS, INC.	Informationstechnologie	2,39%	USA
SALESFORCE, INC.	Informationstechnologie	2,32%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

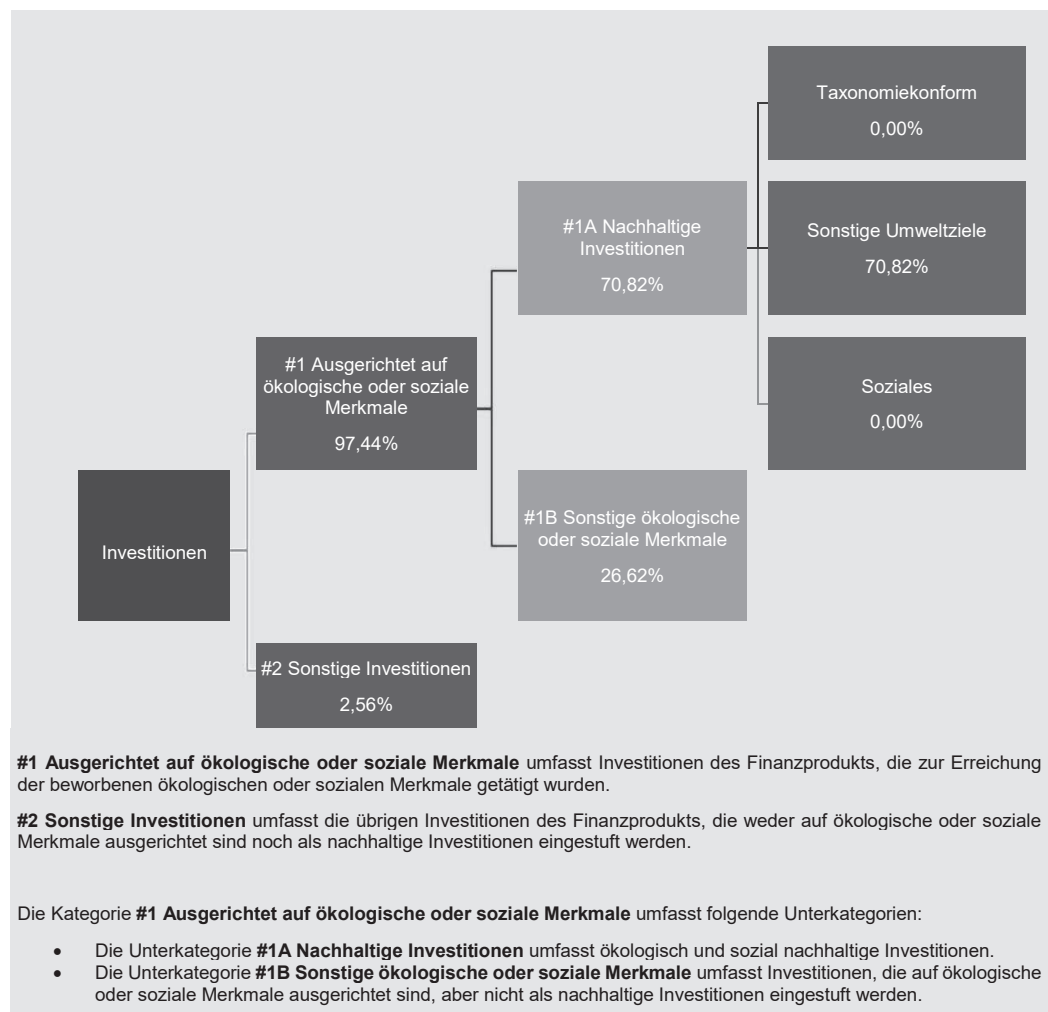
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 70,82 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,44 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,56 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 70,82 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,44%	97,60%	96,29%
#2 Sonstige Investitionen	2,56%	2,40%	3,71%
#1A Nachhaltige Investitionen	70,82%	79,00%	65,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	26,62%	18,60%	31,29%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	70,82%	63,70%	49,00%
Soziales	K. A.	15,30%	16,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	35,84%
Gesundheitssektor	13,53%
Kommunikationsdienste	11,46%
Zyklische Konsumgüter	10,19%
Finanzsektor	10,09%
Industrie	9,23%
Basiskonsumgüter	2,97%
Grundstoffe	1,73%
Immobilien	1,66%
Versorgungsunternehmen	0,73%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Software	17,45%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	12,28%
Allgemeiner Einzelhandel	7,96%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,72%
Finanzdienstleistungen	6,33%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	5,27%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	4,80%
Unterhaltung	3,74%
Überlandtransport	3,37%
Pharmaindustrie	3,34%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,83%
Kapitalmärkte	2,30%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	2,10%
Elektrogeräte	2,07%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,06%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

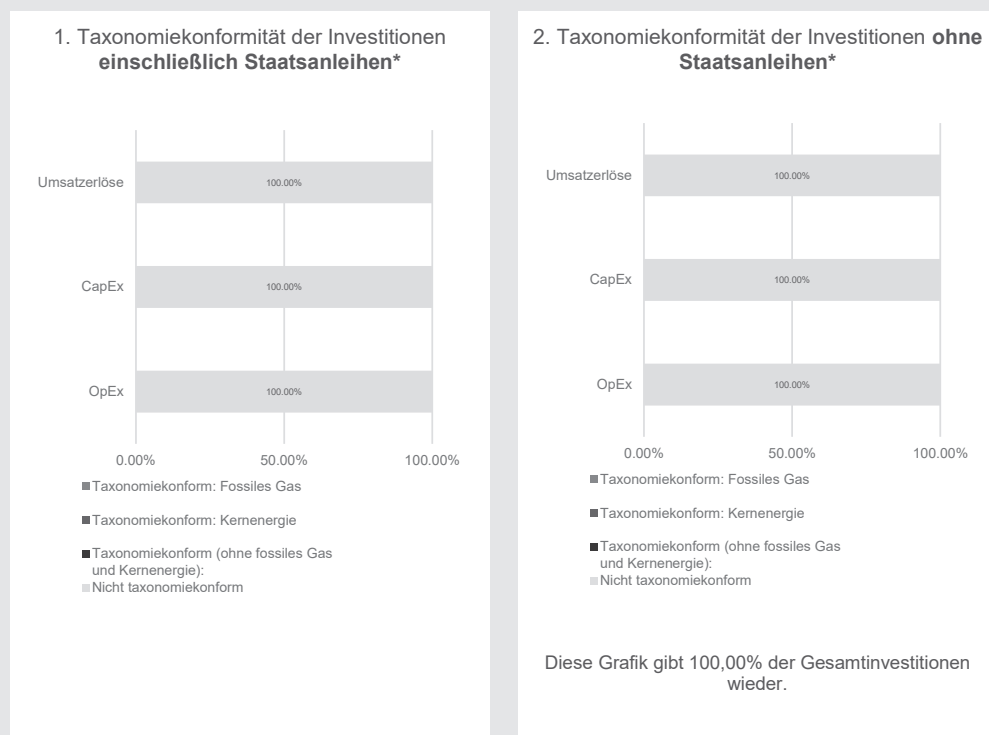
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 70,82 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,56 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 44,4 %

AA: 41,3 %

A: 14,5 %

B: 0 %

2. 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.

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 Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes direkt aus konventionellen Waffen generieren,
- Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen erzielen
- 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

- ☐ Es wurden damit **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
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,15% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. 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.

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:

- 35,15 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI

Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- unternehmenseigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung 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 unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Abstimmung über 448 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden:
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:
- AAA: 24,3 %
- AA: 43,1 %
- A: 32,6 %
- B: 0 %

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	27 541,27	97,53%	25 360,43	98,48%	137 578,85	98,79%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	151,43	97,53%	121,15	98,48%	667,17	98,79%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	470,51	97,53%	330,68	98,48%	9 124,64	98,79%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,53%	0,00%	98,48%	0,00%	98,79%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	34,52%	97,53%	33,59%	97,85%	31,64%	98,79%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,53%	0,00%	97,85%	0,00%	98,79%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● 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 Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 16,73 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten: 18,42 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung 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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des

Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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).



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
VERTEX PHARMACEUTICALS INCORPORATED	Gesundheitssektor	7,18%	USA
BROADCOM INC.	Informationstechnologie	6,94%	USA
CROWDSTRIKE HOLDINGS, INC.	Informationstechnologie	5,15%	USA
AUTODESK, INC.	Informationstechnologie	5,10%	USA
HUBSPOT, INC.	Informationstechnologie	4,55%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	3,67%	USA
THE TJX COMPANIES, INC.	Zyklische Konsumgüter	3,44%	USA
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP.	Kommunikationsdienste	3,00%	USA
TE Connectivity Ltd.	Informationstechnologie	2,88%	Schweiz
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Industrie	2,86%	Irland
TE CONNECTIVITY PUBLIC LIMITED COMPANY	Informationstechnologie	2,57%	Irland
FREEMPORT-MCMORAN INC.	Grundstoffe	2,53%	USA
SERVICENOW, INC.	Informationstechnologie	2,52%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

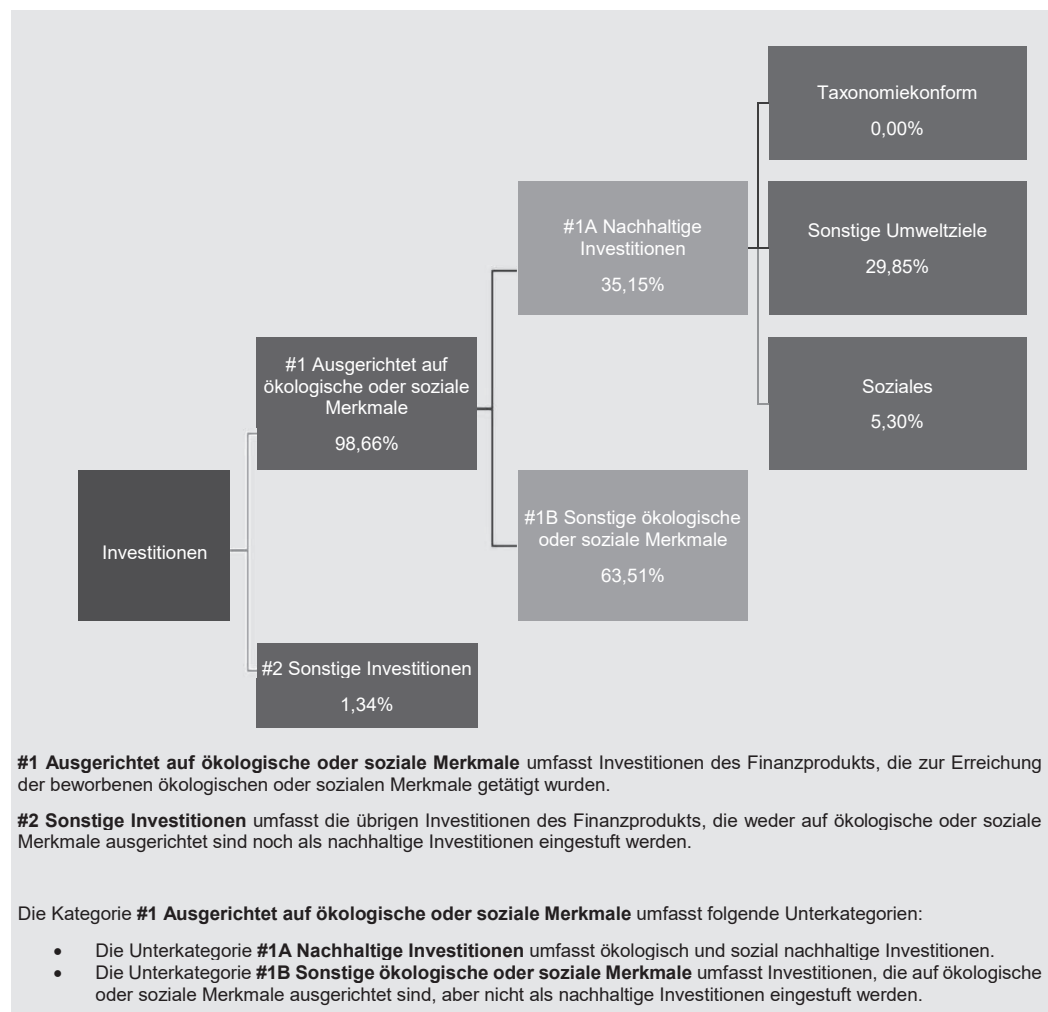
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 35,15 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,66 % des Fondsportfolios waren 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 vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 35,15 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,66%	98,69%	98,79%
#2 Sonstige Investitionen	1,34%	1,31%	1,21%
#1A Nachhaltige Investitionen	35,15%	50,90%	46,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	63,51%	47,79%	52,79%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	29,85%	31,60%	20,00%
Soziales	5,30%	19,30%	26,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	40,45%
Gesundheitssektor	18,75%
Industrie	12,43%
Zyklische Konsumgüter	10,01%
Kommunikationsdienste	9,30%
Finanzsektor	3,67%
Grundstoffe	2,53%
Basiskonsumgüter	1,52%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Software	20,34%
Biotechnologie	10,67%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	7,33%
Unterhaltung	6,00%
IT-Dienstleistungen	5,86%
Elektrogeräte, Instrumente und Komponenten	5,45%
Fachhandel	4,90%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	4,76%
Baustoffe	3,78%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,67%
Kapitalmärkte	3,67%
Metalle u. Bergbau	2,53%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	2,44%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,43%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,37%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



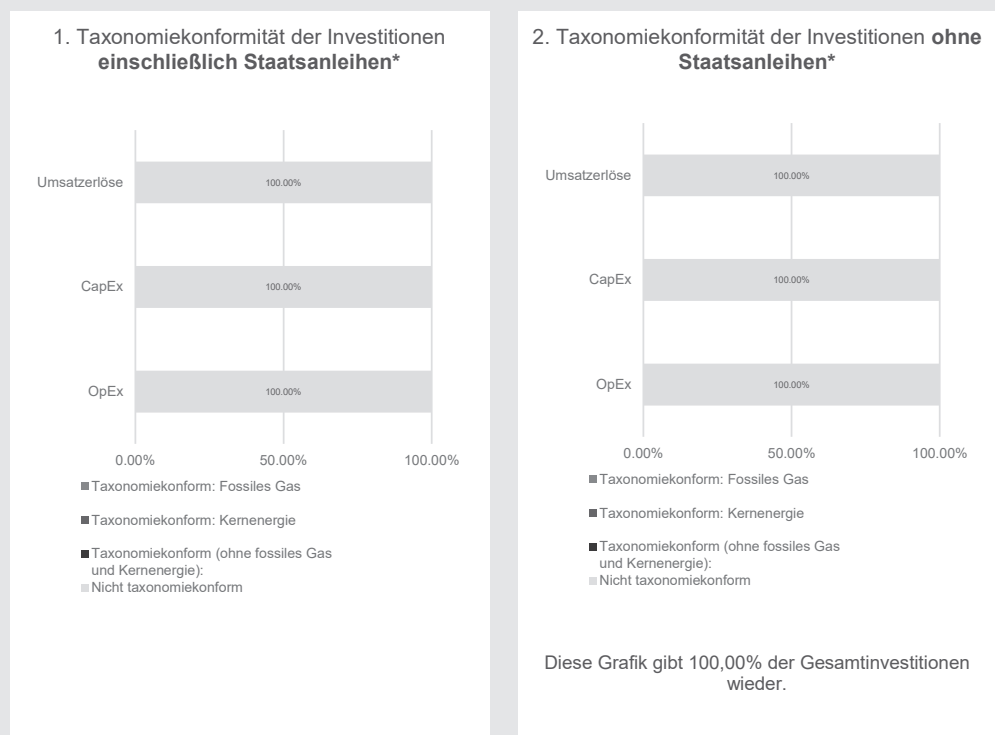
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 29,85 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 5,3 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,34 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 24,3 %
- AA: 43,1 %
- A: 32,6 %
- B: 0 %

2. 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.

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 Branchen 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?

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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 84,13% 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
- ☐ Es wurden damit 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. Dieses unternehmenseigene Verfahren umfasst die Schaffung eines ESG-Ratingsystems, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifizierte, die für das Investment relevant waren. 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.

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:

- 84,13 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- 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-Emissionsintensität), 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), 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?“.
- unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Abstimmung über 772 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden,
- Engagement des Portfolios in Best-in-Class-Emittenten, wie laut unternehmenseigenen ESG-Ratings definiert. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:
 - AAA: 54,3 %
 - AA: 42,4 %
 - A: 3,3 %
 - B: 0 %
- Der Fonds fällt in den Geltungsbereich des Netto-Null-Ziels von ClearBridge und wird daher anhand des Anteils der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftsbasierte Ziele zur Reduktion von Treibhausgasemissionen gesetzt haben, sich zu solchen verpflichtet haben oder Klimaschutzlösungen anbieten: 55,33 %

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Wert	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	55,33%	57,41%	50,51%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	10,10%	20,46%	12,07%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	287 499,37	99,00%	818 684,77	98,78%	1 514 149,99	98,66%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	239,85	99,00%	544,28	98,78%	973,99	98,66%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	780,98	99,25%	1 268,29	99,07%	1 881,15	98,66%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	2,11%	99,12%	4,54%	98,39%	3,78%	98,66%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	5,67%	98,56%	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
empfindlicher biologischer Vielfalt							
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,25%	0,00%	99,07%	0,00%	98,66%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	37,73%	99,12%	36,50%	98,39%	34,46%	98,66%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,12%	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● 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 der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 56,96 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht: 55,33 % 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.

● 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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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:

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 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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 Ausschlüsse 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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. Tretrminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen, Streumunition, weißer Phosphor).



Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	7,48%	USA
APPLE INC.	Informationstechnologie	5,48%	USA
JPMORGAN CHASE & CO.	Finanzsektor	3,82%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	3,47%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	3,33%	USA
BROADCOM INC.	Informationstechnologie	2,46%	USA
EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	2,35%	Irland
THE HOME DEPOT, INC.	Zyklische Konsumgüter	2,34%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	2,20%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INCORPORATED	Gesundheitssektor	2,18%	USA
MORGAN STANLEY	Finanzsektor	2,17%	USA
VISA INC.	Finanzsektor	2,15%	USA
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	Basiskonsumgüter	2,11%	USA
TRANE TECHNOLOGIES PLC	Industrie	2,09%	Irland
The Travelers Companies, Inc.	Finanzsektor	1,96%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

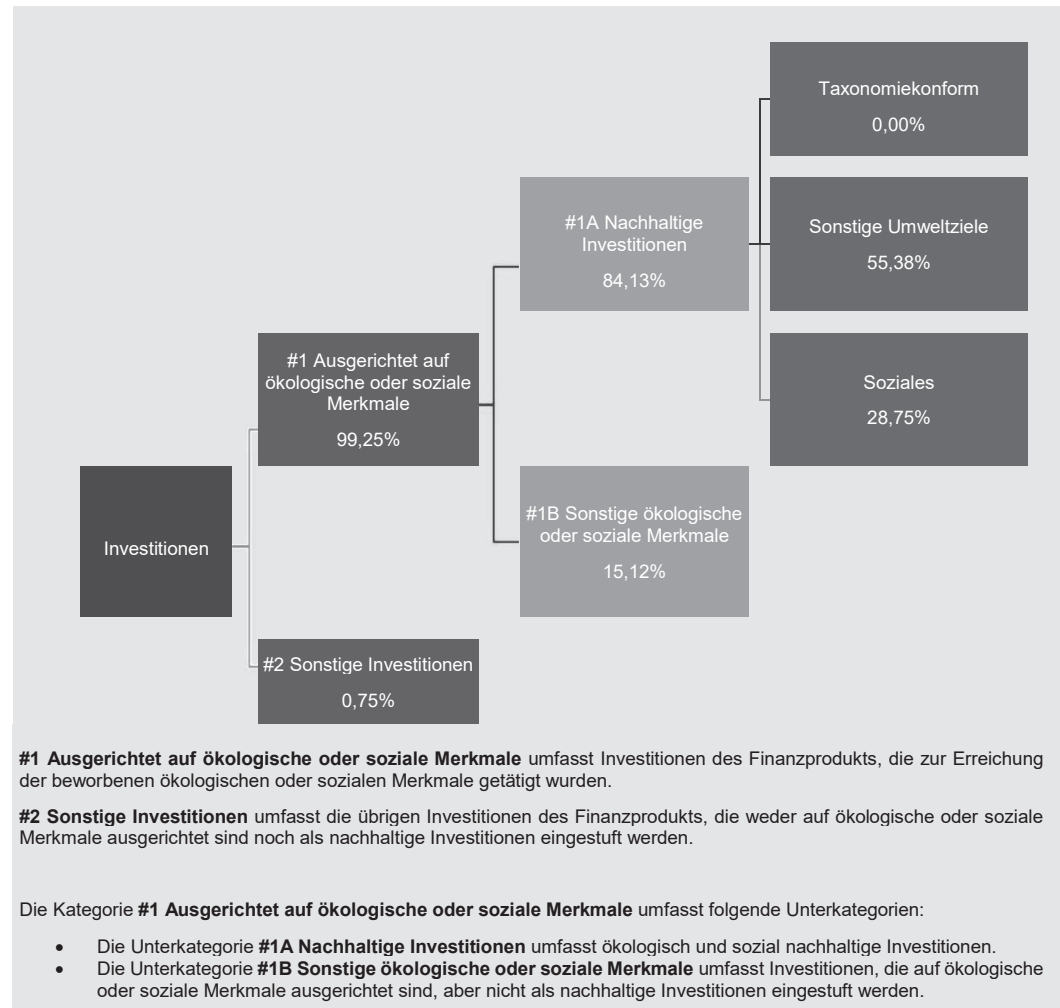
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 84,13 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,25 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,75 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 84,13 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,25%	99,83%	98,66%
#2 Sonstige Investitionen	0,75%	0,17%	1,34%
#1A Nachhaltige Investitionen	84,13%	85,40%	81,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	15,12%	14,43%	17,66%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	55,38%	55,60%	48,00%
Soziales	28,75%	29,80%	33,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	29,00%
Finanzsektor	14,62%
Gesundheitssektor	14,24%
Industrie	11,05%
Zyklische Konsumgüter	10,96%
Basiskonsumgüter	5,69%
Kommunikationsdienste	5,19%
Grundstoffe	3,82%
Immobilien	3,08%
Versorgungsunternehmen	1,58%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Software	12,19%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	8,30%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	6,39%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	4,42%
Versicherungen	4,36%
Banken	4,31%
Elektrogeräte	4,00%
Kapitalmärkte	3,80%
Fachhandel	3,68%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,58%
Pharmaindustrie	3,51%
Allgemeiner Einzelhandel	3,47%
Haushaltsartikel	3,33%
Baustoffe	3,28%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,66%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

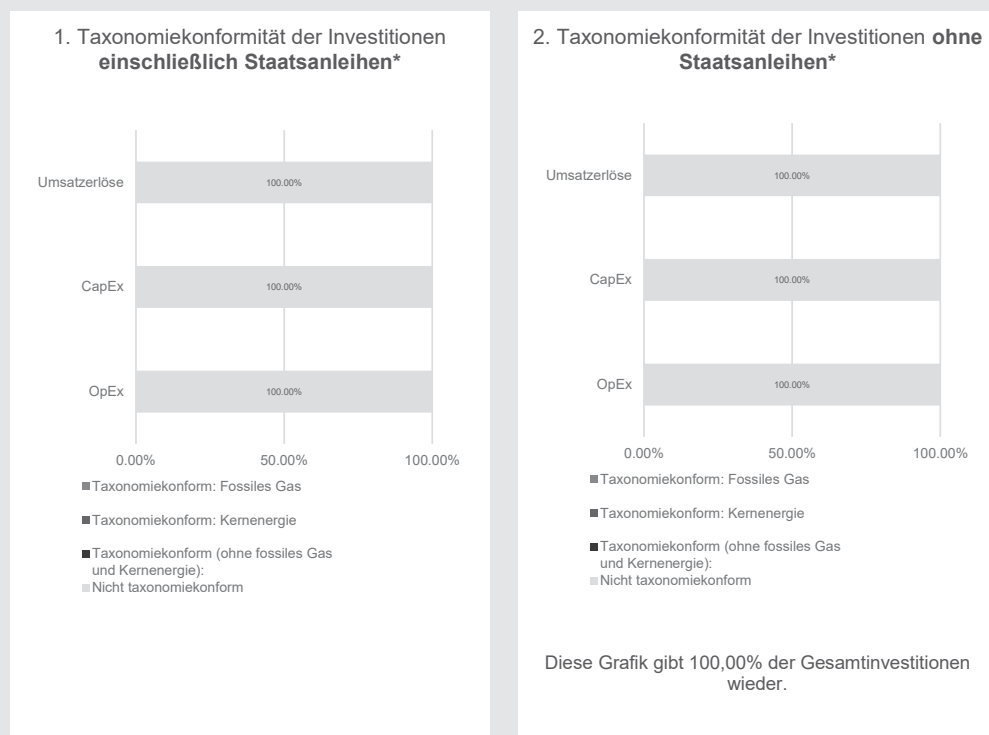
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 55,38 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 28,75 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,75 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 54,3 %
- AA: 42,4 %
- A: 3,3 %
- B: 0 %

2. 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.

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 Branchen 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.

5. Die Anlageverwaltung hielt das ESG-Rating des Portfolios fortlaufend über dem Anlageuniversum des Fonds.



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 ClearBridge Global Growth Leaders 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 50,24% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. 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.

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:

- 50,24 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- Bestimmte Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI

Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in 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?“.

- unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Abstimmung über 1291 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden,
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 26,8 %

AA: 56,7 %

A: 15,2 %

B: 0 %

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	3 459,70	97,80%	1 144,23	97,96%	1 295,82	96,85%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	132,76	97,80%	76,68	97,96%	104,70	96,85%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	445,68	98,25%	314,95	97,96%	486,01	98,22%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,50%	0,00%	98,03%	0,00%	98,22%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	34,90%	98,26%	35,99%	97,20%	36,36%	95,59%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,26%	0,00%	97,20%	0,00%	95,59%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde; 21,34 %
- Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird: 28,90 %.

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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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).



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
APPLE INC.	Informationstechnologie	4,41%	USA
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	4,28%	USA
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	4,23%	USA
AMAZON.COM, INC.	Zyklische Konsumgüter	4,01%	USA
ALPHABET INC.	Kommunikationsdienste	3,08%	USA
ELI LILLY AND COMPANY	Gesundheitssektor	2,70%	USA
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Informationstechnologie	2,43%	Taiwan
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	2,39%	USA
INTERCONTINENTAL EXCHANGE, INC.	Finanzsektor	2,18%	USA
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	1,90%	USA
Chubb Limited	Finanzsektor	1,86%	Schweiz
NOVO NORDISK A/S	Gesundheitssektor	1,71%	Dänemark
MARVELL TECHNOLOGY, INC	Informationstechnologie	1,56%	USA
REPUBLIC SERVICES, INC.	Industrie	1,45%	USA
BROADCOM INC.	Informationstechnologie	1,40%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

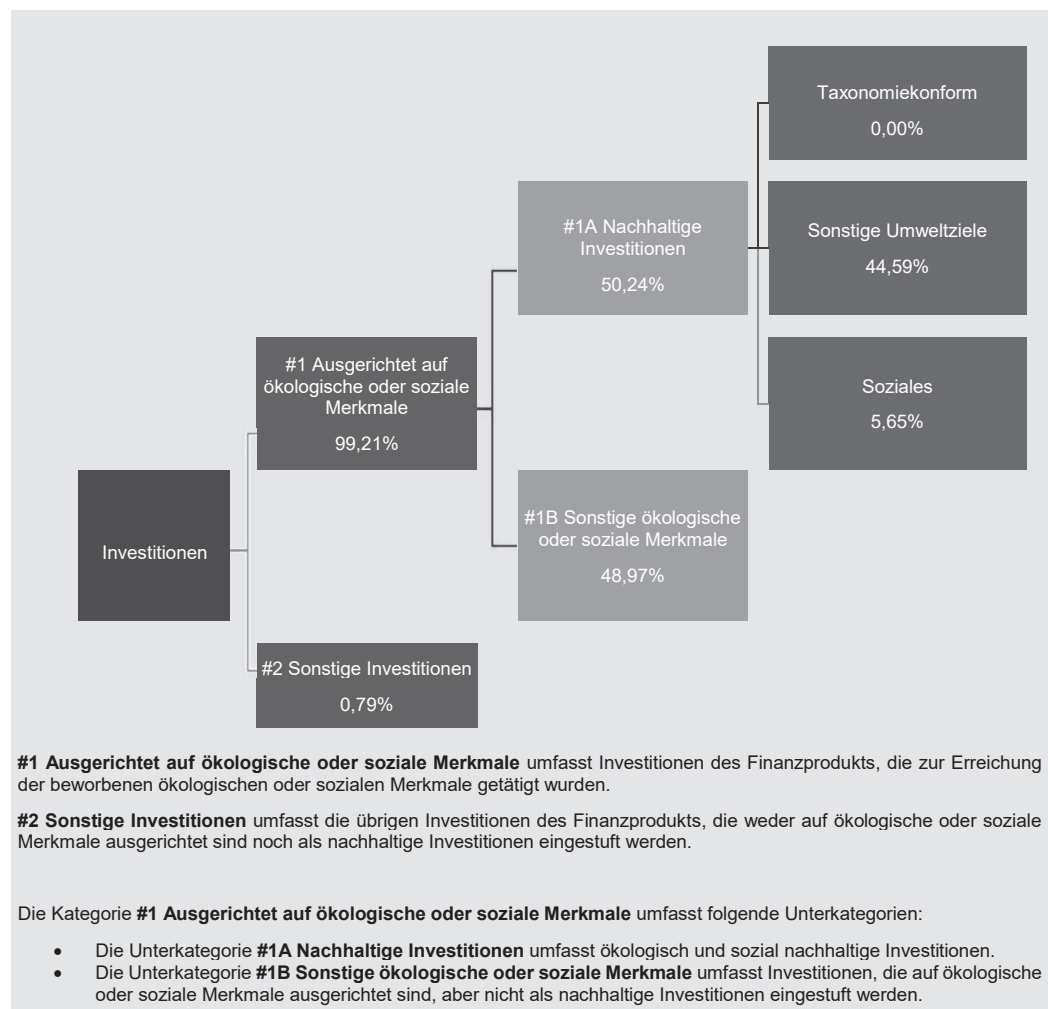
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 50,24 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,21 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,79 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 50,24 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,21%	98,32%	98,22%
#2 Sonstige Investitionen	0,79%	1,68%	1,78%
#1A Nachhaltige Investitionen	50,24%	63,60%	59,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	48,97%	34,72%	39,22%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	44,59%	45,00%	38,00%
Soziales	5,65%	18,60%	21,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	28,65%
Finanzsektor	14,81%
Gesundheitssektor	13,63%
Kommunikationsdienste	12,80%
Zyklische Konsumgüter	11,81%
Industrie	9,51%
Basiskonsumgüter	5,28%
Grundstoffe	1,15%
Versorgungsunternehmen	0,93%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	11,01%
Software	9,81%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	6,24%
Allgemeiner Einzelhandel	5,45%
Kapitalmärkte	5,21%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	5,00%
Pharmaindustrie	4,96%
Banken	4,74%
Unterhaltung	4,38%
Überlandtransport	3,94%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	3,68%
Versicherungen	3,66%
Biotechnologie	2,99%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,52%
Fachhandel	2,20%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



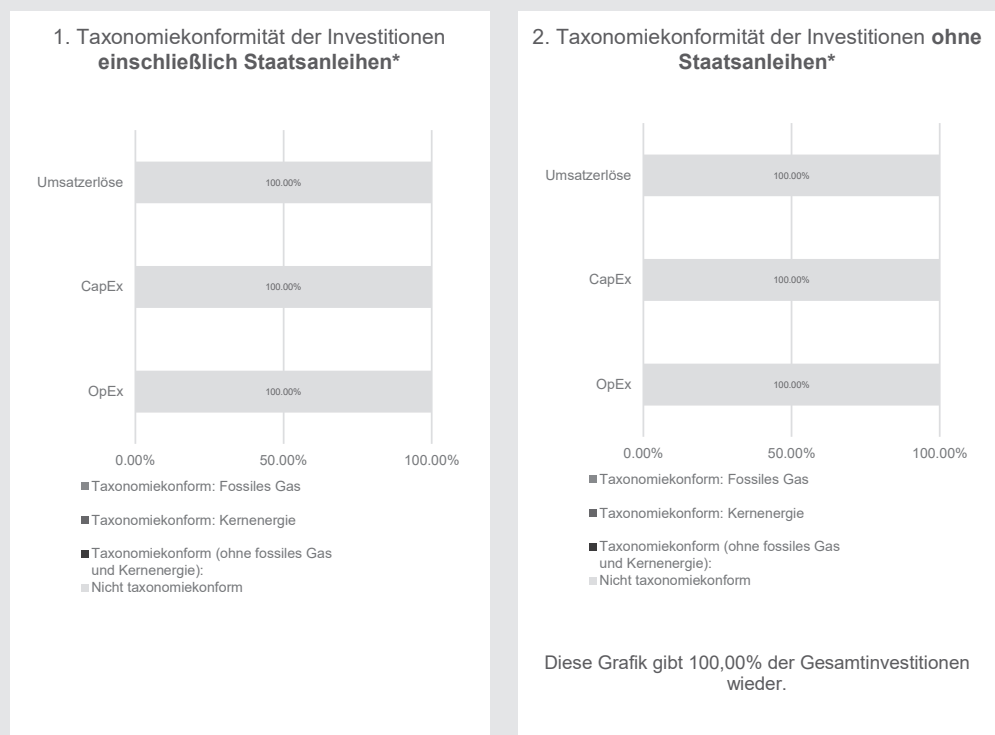
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 44,59 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 5,65 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,79 % 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 26,8 %

AA: 56,7 %

A: 15,2 %

B: 0 %

2. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog und intervenierte auch bei den nach verwaltetem Vermögen und Anzahl der Emittenten untersten 10 % des Portfolios (basieren auf dem unternehmenseigenen ESG-Ratingsystem der Anlageverwaltung). 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
- Unternehmen, die stark in die Förderung und/oder Herstellung fossiler Energieträger und in den Bergbau involviert sind.
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes direkt aus konventionellen Waffen generieren.

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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 55,65% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

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.

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:

- der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung für nachhaltige Investitionen definiert sind, betrug 55,65 %, und
- das ESG-Rating des Fonds (7,41) 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 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	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Wert	Wert	Wert	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,41	7,35	7,31
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,67	6,58	6,45

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO2e	336 618,28	97,72%	376 657,11	97,18%	319 510,77	92,41%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO2e/investierte Mio. USD	459,24	97,72%	430,19	97,18%	313,64	92,41%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	1 795,77	97,72%	1 566,37	97,18%	2 125,77	95,98%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	58,89%	97,72%	42,85%	95,77%	43,82%	92,41%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,72%	0,00%	97,18%	0,00%	95,98%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,72%	0,00%	95,77%	0,00%	92,41%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 beitrugen 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 (21 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (28 %)
- Wasserversorger, die die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleisten (8 %)
- Kommunikationsinfrastruktur, die eine Alternative zum Verkehr bietet und gleichzeitig durch Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen gesellschaftliche Wirkung erzielen kann (0 %)

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Waren und Dienstleistungen (46 % des Portfolios)
- THG-Emissionsintensität und Emissionsreduktionsziele im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Dritten und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (52 % 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 Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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, welche 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-Emissionsintensität)

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 ihres 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ENTERGY CORPORATION	Versorgungsunternehmen	5,10%	USA
NEXTERA ENERGY, INC.	Versorgungsunternehmen	4,89%	USA
SEVERN TRENT PLC	Versorgungsunternehmen	4,73%	Vereinigtes Königreich
PG&E CORPORATION	Versorgungsunternehmen	4,30%	USA
CSX Corporation	Industrie	4,18%	USA
Dominion Energy, Inc.	Versorgungsunternehmen	3,32%	USA
REDEIA CORPORACION, S.A.	Versorgungsunternehmen	3,30%	Spanien
E.ON SE	Versorgungsunternehmen	3,26%	Deutschland
ENEL - SPA	Versorgungsunternehmen	3,25%	Italien
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	Industrie	3,15%	Deutschland
GETLINK S.E.	Industrie	3,09%	Frankreich
Ferrovial SE	Industrie	3,06%	Niederlande
UNITED UTILITIES GROUP PLC	Versorgungsunternehmen	3,05%	Vereinigtes Königreich
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	3,01%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

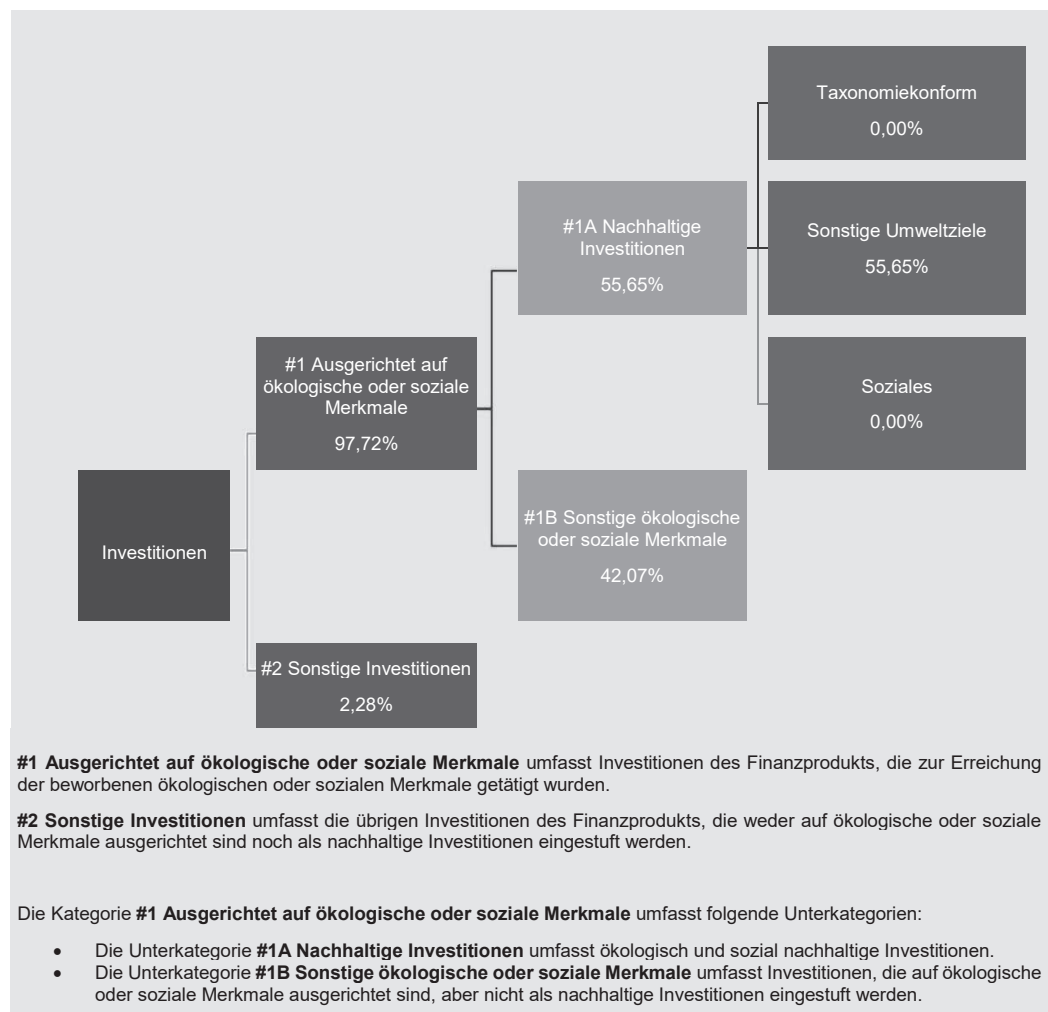
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 55,65 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,72 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,28 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 55,65 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,72%	98,55%	95,98%
#2 Sonstige Investitionen	2,28%	1,45%	40,20%
#1A Nachhaltige Investitionen	55,65%	61,70%	57,35%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	42,07%	36,85%	38,63%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	55,65%	61,70%	57,35%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	58,07%
Industrie	24,60%
Energie	11,84%
Immobilien	3,21%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Stromversorger	36,02%
Multi-Versorger	13,78%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	11,84%
Überlandtransport	10,67%
Verkehrsinfrastruktur	10,11%
Wasserversorger	7,78%
Bau- u. Ingenieurwesen	3,82%
Spezialisierte REITs	3,21%
Gasversorger	0,49%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

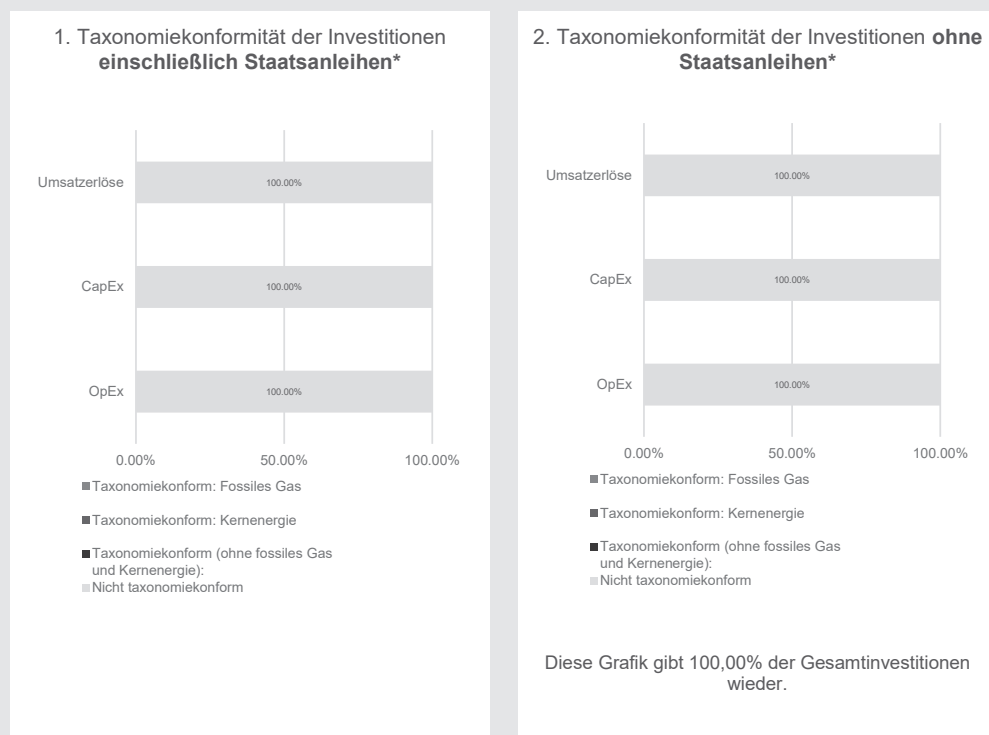
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 55,65 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,28 % 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; Beurteilung erfolgt anhand der unternehmenseigenen Scorecard der Anlageverwaltung (siehe unten)
 - Engagement, einschließlich 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. Den Unternehmen werden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 19 %
- AA: 79 %
- A: 3 %
- 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: 63 %
- Soziales: 63 %
- Governance: 74 %

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?

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 ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (der „Fonds“)



**FRANKLIN
TEMPLETON**

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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 54,79% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

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.

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:

- der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investitionen, wie sie in der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung für nachhaltige Investitionen definiert sind, betrug 54,79 %, und
- das ESG-Rating des Fonds (7,57) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,78), 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.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
	Wert	Wert	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,57	7,82	7,89
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,78	6,67	6,58

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	tCO ₂ e	138 961,75	96,96%	157 590,78	96,86%	139 114,60	96,67%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	467,24	96,96%	444,57	96,86%	351,77	96,67%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	1 923,74	96,96%	1 803,46	96,86%	2 500,32	98,02%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	60,19%	96,96%	54,13%	95,18%	61,11%	94,59%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,17%	0,00%	96,86%	0,00%	98,02%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,57%	0,00%	95,18%	0,00%	94,59%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 beitrugen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassen:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbare Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern (30 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (14 %)
- Wasserversorger, die die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleisten (7 %)
- Kommunikationsinfrastruktur, die eine Alternative zum Verkehr bietet und gleichzeitig durch Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen gesellschaftliche Wirkung erzielen kann (3 %)

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Waren und Dienstleistungen (44,1 % des Portfolios)
- THG-Emissionsintensität und Emissionsreduktionsziele im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Drittanbieter und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (46,7 % 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 Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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, welche 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-Emissionsintensität)

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 ihres Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
ENTERGY CORPORATION	Versorgungsunternehmen	5,35%	USA
NEXTERA ENERGY, INC.	Versorgungsunternehmen	4,67%	USA
Dominion Energy, Inc.	Versorgungsunternehmen	4,19%	USA
REDEIA CORPORACION, S.A.	Versorgungsunternehmen	4,17%	Spanien
CROWN CASTLE INC.	Immobilien	3,94%	USA
SEVERN TRENT PLC	Versorgungsunternehmen	3,80%	Vereinigtes Königreich
E.ON SE	Versorgungsunternehmen	3,76%	Deutschland
UNION PACIFIC CORPORATION	Industrie	3,71%	USA
PEMBINA PIPELINE CORPORATION	Energie	3,42%	Kanada
ENEL - SPA	Versorgungsunternehmen	3,35%	Italien
OGE ENERGY CORP.	Versorgungsunternehmen	3,23%	USA
EDP, S.A.	Versorgungsunternehmen	3,04%	Portugal
SNAM S.P.A.	Versorgungsunternehmen	2,81%	Italien
NATIONAL GRID PLC	Versorgungsunternehmen	2,76%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

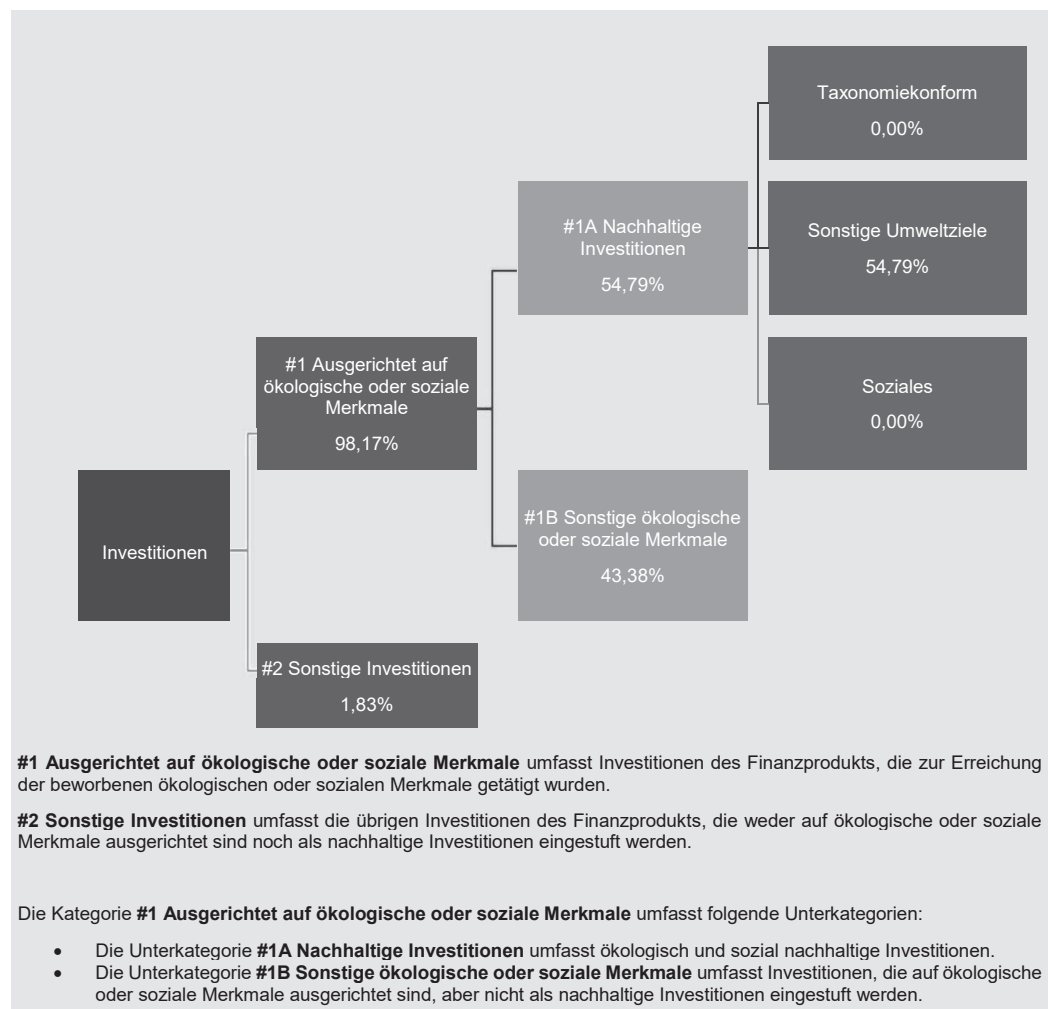
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 54,79 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,17 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,83 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 54,79 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,17%	97,37%	98,02%
#2 Sonstige Investitionen	1,83%	2,63%	1,98%
#1A Nachhaltige Investitionen	54,79%	50,10%	35,52%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	43,38%	47,27%	62,50%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	54,79%	50,10%	35,52%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.

● **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	In % der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	64,51%
Industrie	14,49%
Energie	12,95%
Immobilien	6,23%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Stromversorger	36,29%
Multi-Versorger	13,70%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	12,95%
Verkehrsinfrastruktur	7,65%
Spezialisierte REITs	6,23%
Wasserversorger	6,09%
Gasversorger	5,26%
Überlandtransport	4,19%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	3,17%
Bau- u. Ingenieurwesen	2,65%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



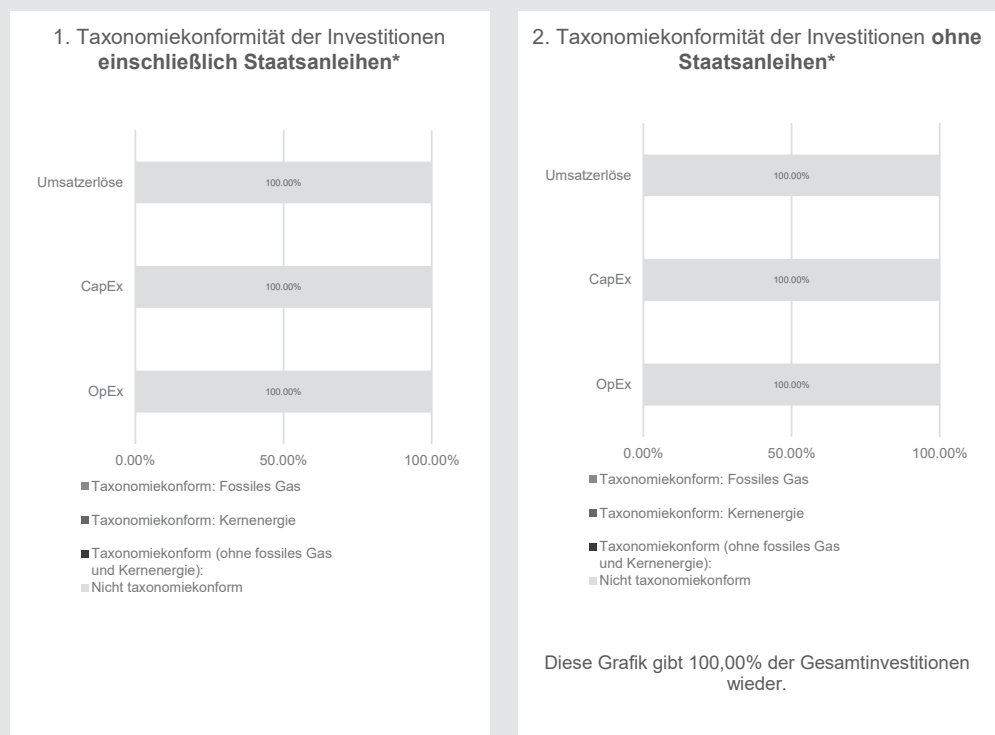
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.

 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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 54,79 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,83 % 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; Beurteilung erfolgt anhand der unternehmenseigenen Scorecard der Anlageverwaltung (siehe unten)
 - Engagement, einschließlich 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. Den Unternehmen werden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 17 %
- AA: 78 %
- A: 5 %
- 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.

Das Engagement des Fonds im Referenzzeitraum stellt sich wie folgt dar:

- Umwelt: 57 %
- Sozial: 57 %
- Governance: 70 %

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?

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 ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900JA2MNQ8SPZ8938



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 46,71% 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
- ☐ Es wurden damit 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 die Anlageverwaltung 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?

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:

- 46,71 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).
- 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-Emissionsintensität), 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 UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), 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?“.
- Abstimmung über 650 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden:
- Portfoliobeteiligung an Unternehmen, die sich wissenschaftsbasierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt haben und sich dazu verpflichtet haben (19,4 %)

Unternehmenseigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung 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 unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich			
		2025		2024	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 3 USD	tCO ₂ e	11 729,82	94,38%	5 447,99	91,65%
CO ₂ -Fußabdruck (USD)	tCO ₂ e/investierte Mio. USD	1 971,08	94,38%	1 167,84	91,65%
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	2 442,10	94,38%	1 276,97	91,65%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	GWh pro Mio. USD Absatz	1,54	94,38%	2,90	76,77%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,38%	0,00%	91,65%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	37,96%	94,38%	37,73%	91,65%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,38%	0,00%	91,65%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

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 Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren 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 der Anlageverwaltung ermittelt wurde: 27,3 % des Portfolios
- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität 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 Klimaschutzlösungen anbieten: 19,4 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung 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 sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, 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 PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

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, welche 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 der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

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 und sozialen Aspekten und Faktoren im Hinblick auf die Unternehmensführung einbezogen.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, 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 Managementteams und andere Faktoren.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Zudem konnte die Anlageverwaltung Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

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, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität 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).



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Hitachi, Ltd.	Industrie	4,33%	Japan
COMPASS GROUP PLC	Zyklische Konsumgüter	4,19%	Vereinigtes Königreich
WELLS FARGO & COMPANY	Finanzsektor	4,17%	USA
TotalEnergies SE	Energie	3,81%	Frankreich
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A.	Finanzsektor	3,80%	Spanien
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitssektor	3,40%	Vereinigtes Königreich
NEXANS SA	Industrie	3,39%	Frankreich
UNILEVER PLC	Basiskonsumgüter	3,39%	Vereinigtes Königreich
PAYPAL HOLDINGS, INC.	Finanzsektor	3,38%	USA
ORACLE CORPORATION	Informationstechnologie	3,24%	USA
FISERV, INC.	Finanzsektor	3,22%	USA
META PLATFORMS, INC.	Kommunikationsdienste	3,22%	USA
THE CHARLES SCHWAB CORPORATION	Finanzsektor	3,19%	USA
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP, INC.	Finanzsektor	3,10%	USA
Siemens Aktiengesellschaft	Industrie	3,07%	Deutschland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

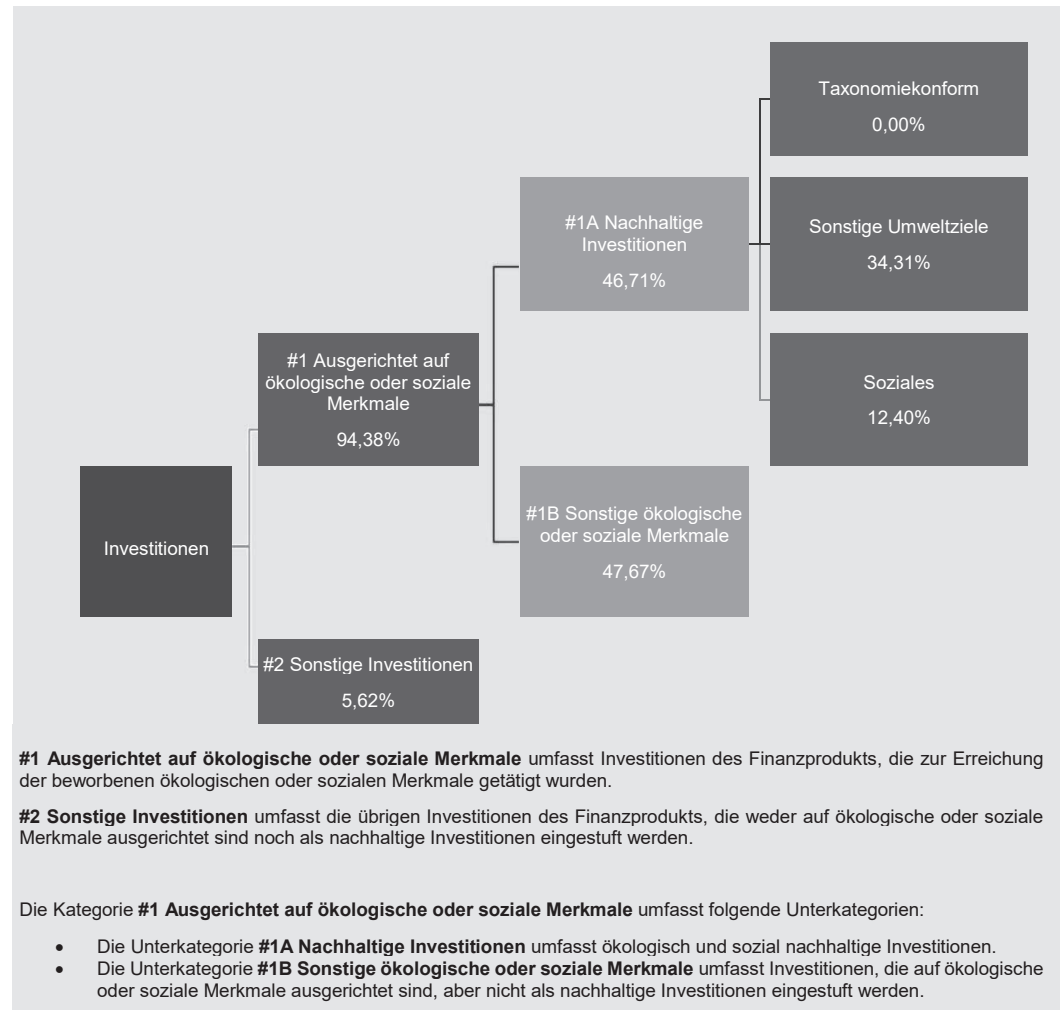
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 46,71 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,38 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,62 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 46,71 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich	
	2025	2024
Anlagekategorie	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	94,38%	92,40%
#2 Sonstige Investitionen	5,62%	7,60%
#1A Nachhaltige Investitionen	46,71%	46,80%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	47,67%	45,60%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	34,31%	32,20%
Soziales	12,40%	14,60%

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	25,07%
Industrie	24,00%
Gesundheitssektor	11,55%
Versorgungsunternehmen	9,27%
Energie	6,66%
Basiskonsumgüter	4,80%
Zyklische Konsumgüter	4,19%
Informationstechnologie	3,24%
Kommunikationsdienste	3,22%
Grundstoffe	2,38%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Banken	11,72%
Elektrogeräte	10,21%
Industriekonzerne	7,40%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,66%
Finanzdienstleistungen	6,60%
Pharmaindustrie	6,09%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,80%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	4,19%
Versicherungen	3,56%
Software	3,24%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,22%
Kapitalmärkte	3,19%
Multi-Versorger	2,95%
Überlandtransport	2,43%
Metalle u. Bergbau	2,38%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

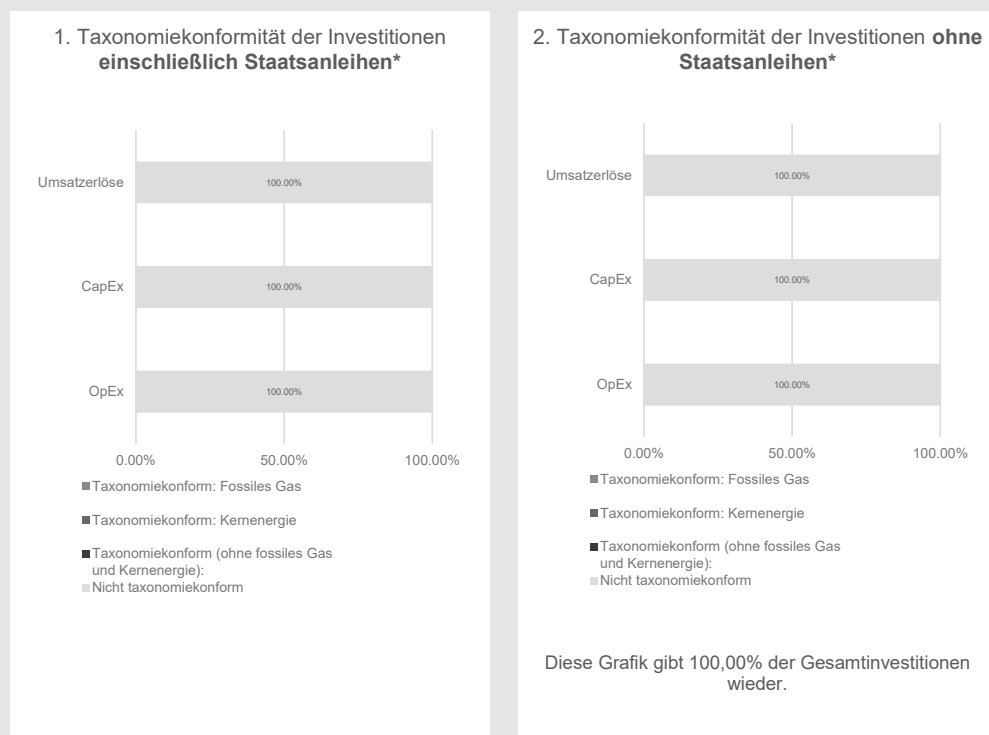
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Investitionen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio Ende Februar 2025 zu 34,31 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 12,40 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 5,62 % 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 Branchen 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 Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 30 %

AA: 42 %

A: 27 %

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 Anlageverwaltung trat im Kalenderjahr mit mindestens 50 % der im Portfolio enthaltenen Unternehmen und zahlreichen weiteren Emittenten in einen aktiven Dialog.

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?

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 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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 80,73% 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
- ☐ Es wurden damit 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 umstrittenen 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?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Wie im eigenen Rahmen der Anlageverwaltung auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 80,15 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

sozialen Merkmale erreicht werden.

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 61 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftsbasierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 16 % 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 sechsmal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien und die Vergütung von Mitgliedern dieser Gremien besprochen. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Insgesamt fanden im Berichtszeitraum 40 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 dienen 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, die auf der Grundlage der Annahme wissenschaftsbasierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Wert	Wert	Wert	Wert
Interventionen: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%	0,00%	40,00%
Interventionen: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%	14,00%	0,00%
Interventionen: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	17,00%	71,00%	0,00%
Interventionen: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	83,00%	14,00%	40,00%
Interventionen: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%	0,00%	20,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	0,00%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	0,00%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	60,70%	59,70%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	16,20%	22,10%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	2,40%	9,60%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	20,70%	8,60%	k. A.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO ₂ e	4 808,95	99,45%	8 886,22	99,38%	8 716,25	99,49%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	109,53	99,45%	65,92	99,38%	67,27	99,49%
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	592,11	99,45%	358,02	99,38%	431,12	99,49%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,45%	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	50,72%	99,45%	57,73%	83,94%	65,03%	85,02%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,19	99,45%	0,31	92,25%	0,34	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	99,45%	0,02	92,25%	0,02	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,45%	0,00	92,25%	0,00	93,86%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	9,86%	99,45%	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	1,01	10,62%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,07	90,86%	0,05	43,01%	0,06	36,29%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,45%	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 Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,45%	43,22%	99,38%	52,33%	99,12%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,31%	78,12%	12,16%	37,97%	11,75%	20,44%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	38,63%	99,45%	35,84%	99,38%	32,86%	99,49%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,45%	0,00%	99,38%	0,00%	99,49%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Anteil des Fonds-Nettoinventarwerts, der in Unternehmen mit einem wissenschaftsbasierten Ziel investiert ist, stieg gegenüber dem Ende des vorherigen Berichtszeitraums von 60 % leicht auf 61 %. Im selben Zeitraum ging der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftsbasierter Ziele verpflichtet haben, von 22 % auf 16 % zurück.

Im Vergleich zum vorherigen Berichtszeitraum ging der Austausch zu ESG-Themen mit dem Ziel der Einflussnahme auf das Verhalten der Unternehmen leicht zurück. Die Zahl der Interventionen sank von 7 auf 6. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

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 die Anlageverwaltung 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 des DNSH-Prinzips 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 einem hohen und nicht kontrollierten CO₂-Fußabdruck in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 von der Anlageverwaltung 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?

Die Anlageverwaltung berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 verpflichtenden PAI-Indikatoren und zwei optionale Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo die Anlageverwaltung potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

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.

Weitere Informationen darüber, inwiefern die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung 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, welche 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 die Anlageverwaltung 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. Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat die Anlageverwaltung mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik der Anlageverwaltung ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 verpflichtenden PAI und der beiden optionalen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Die Anlageverwaltung 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-Fußabdruck) 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 Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) 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
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik der Anlageverwaltung in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie der Anlageverwaltung für verantwortliches Investieren.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der größte Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORPORATION	Informationstechnologie	8,59%	USA
MICROSOFT CORPORATION	Informationstechnologie	5,34%	USA
ASML Holding N.V.	Informationstechnologie	5,13%	Niederlande
Ferrari N.V.	Zyklische Konsumgüter	4,79%	Italien
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Grundstoffe	4,24%	Vereinigtes Königreich
Atlas Copco Aktiebolag	Industrie	3,74%	Schweden
MASTERCARD INCORPORATED.	Finanzsektor	3,69%	USA
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	3,60%	Frankreich
MONCLER S.P.A.	Zyklische Konsumgüter	3,58%	Italien
SARTORIUS STEDIM BIOTECH S.A.	Gesundheitssektor	3,43%	Frankreich
Adyen N.V.	Finanzsektor	3,38%	Niederlande
KINGSPAN GROUP PUBLIC LIMITED COMPANY	Industrie	3,19%	Irland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

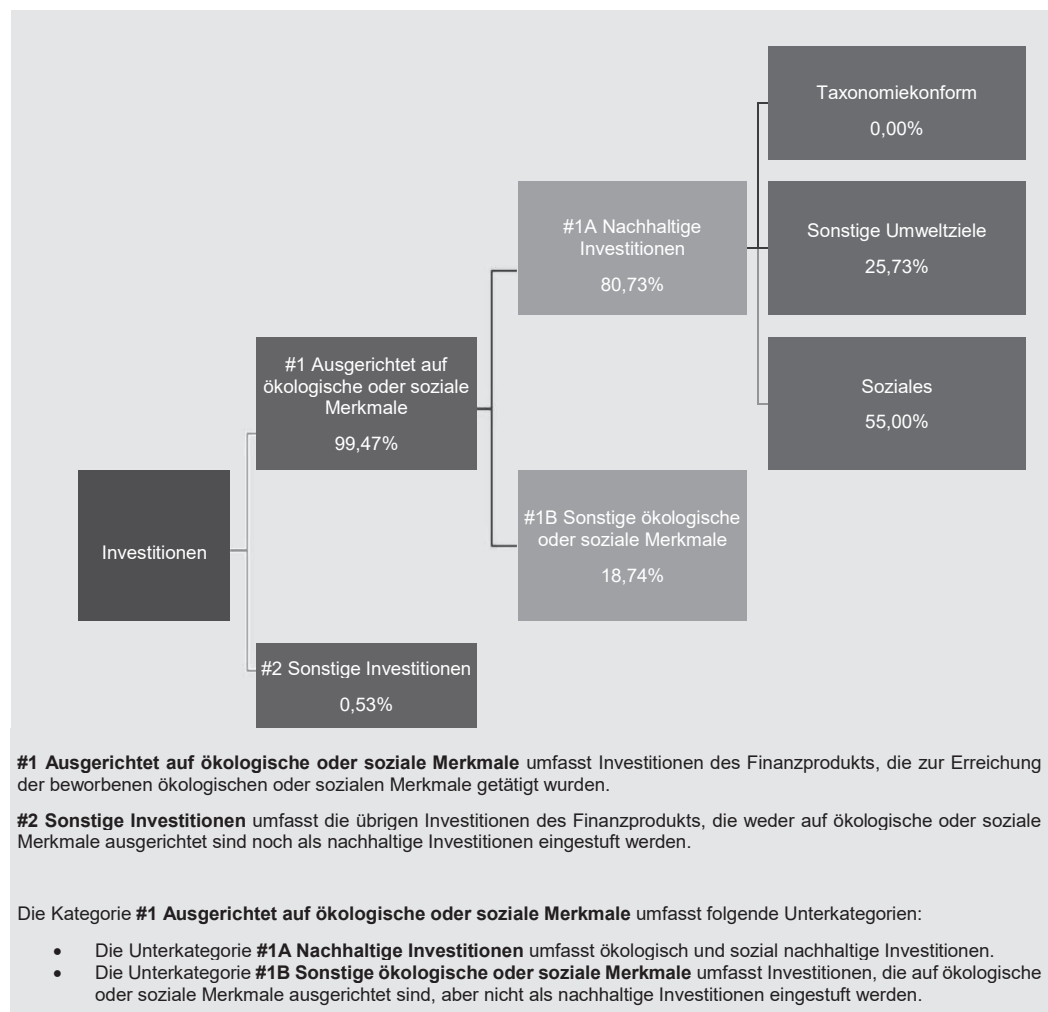
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 80,73 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,47 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,53 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 80,73 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,47%	97,74%	99,50%
#2 Sonstige Investitionen	0,53%	2,26%	0,50%
#1A Nachhaltige Investitionen	80,73%	83,84%	88,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	18,74%	13,90%	11,50%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	25,73%	30,96%	30,00%
Soziales	55,00%	52,88%	58,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,06%
Gesundheitssektor	27,07%
Zyklische Konsumgüter	12,65%
Finanzsektor	9,50%
Industrie	8,19%
Grundstoffe	5,53%
Basiskonsumgüter	5,42%
Kommunikationsdienste	1,01%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	14,97%
Software	11,36%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	8,33%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	7,64%
Finanzdienstleistungen	7,07%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	6,89%
Pharmaindustrie	6,03%
Chemische Erzeugnisse	5,53%
Automobilindustrie	4,79%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,60%
Baustoffe	4,45%
Maschinen	3,74%
Biotechnologie	2,57%
Gesundheitstechnologie	2,50%
Kapitalmärkte	2,43%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

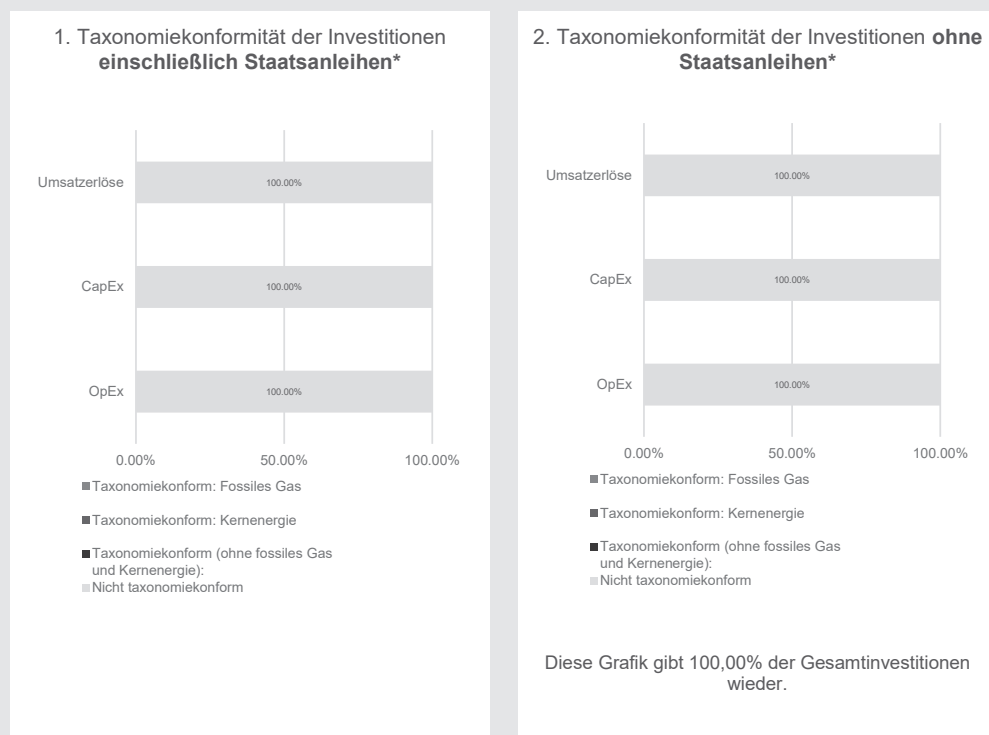
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 25,73 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 55,00 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,53 % 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 bei Portfoliounternehmen zu Themen wie Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien und der Vergütung von Mitgliedern dieser Gremien.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf unternehmenseigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle sonstigen ausgeschlossenen 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 mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher 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 (an regulierten Börsen auf der ganzen Welt notierte oder gehandelte Aktien).



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“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300Y8TPNIB3NAMF62



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 67,37% 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
- ☐ Es wurden damit 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 umstrittenen 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?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Wie im eigenen Rahmen der Anlageverwaltung auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 68,13 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

sozialen Merkmale erreicht werden.

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 20 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftsbasierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 8 % 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 30 Mal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien, die Pläne der Unternehmen für den Übergang zu netto Null CO₂-Emissionen und die Unternehmenskultur besprochen. 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 dienen 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, die auf der Grundlage der Annahme wissenschaftsbasierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Wert	Wert	Wert	Wert
Interventionen: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	28,00%	23,00%	4,00%
Interventionen: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	13,00%	11,00%	12,00%
Interventionen: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	50,00%	53,00%	58,00%
Interventionen: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	9,00%	9,00%	19,00%
Interventionen: 5. Unternehmen greift das Thema auf	1,00%	4,00%	8,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	0,00%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	1,40%	0,00%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	18,60%	17,40%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	8,00%	11,00%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	8,40%	14,30%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	63,70%	57,30%	k. A.

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO ₂ e	8 203,74	97,07%	11 584,46	97,41%	11 085,00	96,39%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	268,01	97,07%	362,44	97,41%	329,97	96,39%
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	753,27	97,07%	912,40	97,32%	1 004,71	96,39%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,22%	96,74%	6,87%	97,20%	7,95%	96,39%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	88,01%	96,11%	86,53%	75,94%	86,15%	81,90%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,39	96,60%	1,43	81,19%	1,47	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,74	96,60%	1,42	81,19%	3,01	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,46	96,60%	0,52	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	96,60%	0,21	81,19%	0,22	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	96,60%	0,07	81,19%	0,07	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,36%	96,74%	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	4,97%	0,00	3,34%	0,02	14,67%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,57	95,16%	1,07	47,28%	0,45	50,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,74%	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 Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,74%	66,13%	97,20%	74,61%	95,98%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	18,26%	63,60%	24,15%	8,73%	25,65%	9,73%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	22,08%	96,74%	19,98%	97,12%	18,30%	96,39%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,74%	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Anteil des Fonds-Nettoinventarwerts, der in Unternehmen mit einem wissenschaftsbasierten Ziel investiert ist, stieg per 28. Februar 2025 auf 20 % (gegenüber 17 % per 29. Februar 2024). Im selben Zeitraum ging der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftsbasierter Ziele verpflichtet haben, von 11 % auf 8 % zurück. Dies liegt zum Teil daran, dass Unternehmen, die sich zuvor zur Festlegung von Zielvorgaben verpflichtet hatten, nun diesen Schritt vollziehen und ihre Verpflichtungen konkretisieren, zum Teil sind auch Portfolio-Umschichtungen dafür verantwortlich.

Die Zahl der Interventionen in der frühen 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.

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 die Anlageverwaltung 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 des DNSH-Prinzips 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 einem hohen und nicht kontrollierten CO₂-Fußabdruck in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 von der Anlageverwaltung 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?

Die Anlageverwaltung berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 verpflichtenden PAI-Indikatoren und zwei optionale Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo die Anlageverwaltung potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter

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.

Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigte. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung 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, welche 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 die Anlageverwaltung 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. Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat die Anlageverwaltung mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik der Anlageverwaltung ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 verpflichtenden PAI und der beiden optionalen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Die Anlageverwaltung 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-Fußabdruck) 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 Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) 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
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik der Anlageverwaltung in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie der Anlageverwaltung für verantwortliches Investieren.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	Informationstechnologie	9,60%	Taiwan
Tencent Holdings Limited	Kommunikationsdienste	7,54%	China
Samsung Electronics Co., Ltd.	Informationstechnologie	6,72%	Südkorea
HDFC BANK LIMITED	Finanzsektor	4,05%	Indien
SK hynix Inc.	Informationstechnologie	3,79%	Südkorea
ICICI BANK LIMITED	Finanzsektor	3,53%	Indien
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	Energie	2,86%	Indien
TITAN COMPANY LIMITED	Zyklische Konsumgüter	2,42%	Indien
ALIBABA GROUP HOLDING LIMITED	Zyklische Konsumgüter	2,40%	China
MediaTek Inc.	Informationstechnologie	2,37%	Taiwan
MEITUAN	Zyklische Konsumgüter	2,29%	China
China Merchants Bank Co., Ltd.	Finanzsektor	2,07%	China
QUANTA COMPUTER INC.	Informationstechnologie	2,00%	Taiwan



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

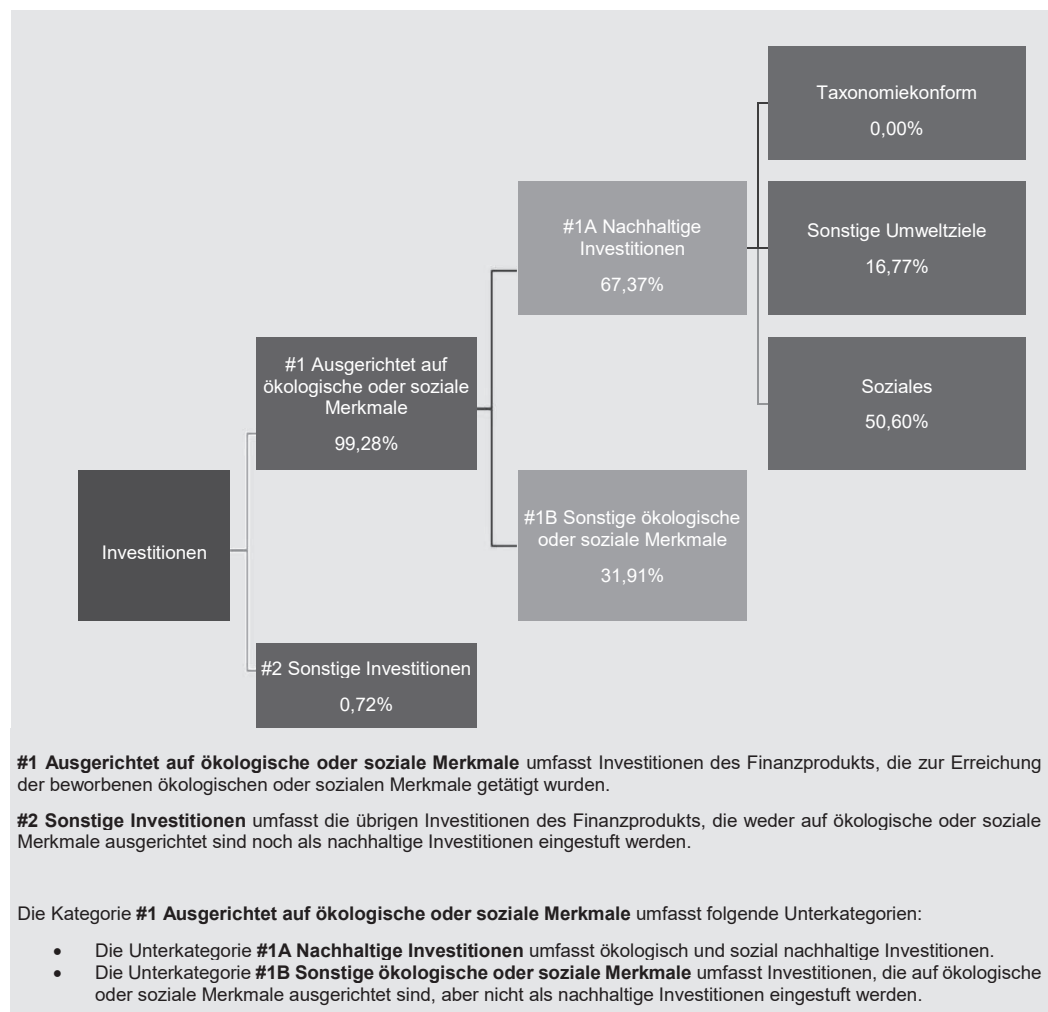
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 67,37 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,28 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,72 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 67,37 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,28%	99,12%	97,90%
#2 Sonstige Investitionen	0,72%	0,88%	2,10%
#1A Nachhaltige Investitionen	67,37%	72,55%	73,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	31,91%	26,57%	24,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	16,77%	20,18%	26,00%
Soziales	50,60%	52,37%	47,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	31,40%
Finanzsektor	25,96%
Zyklische Konsumgüter	15,89%
Kommunikationsdienste	7,88%
Grundstoffe	4,78%
Industrie	4,69%
Energie	3,49%
Gesundheitssektor	2,84%
Basiskonsumgüter	2,23%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Banken	21,38%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	17,17%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	8,72%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,69%
Allgemeiner Einzelhandel	6,32%
IT-Dienstleistungen	3,84%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,67%
Versicherungen	3,59%
Elektrogeräte	3,51%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,49%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,42%
Automobilindustrie	2,33%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,22%
Metalle u. Bergbau	1,77%
Elektrogeräte, Instrumente und Komponenten	1,66%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

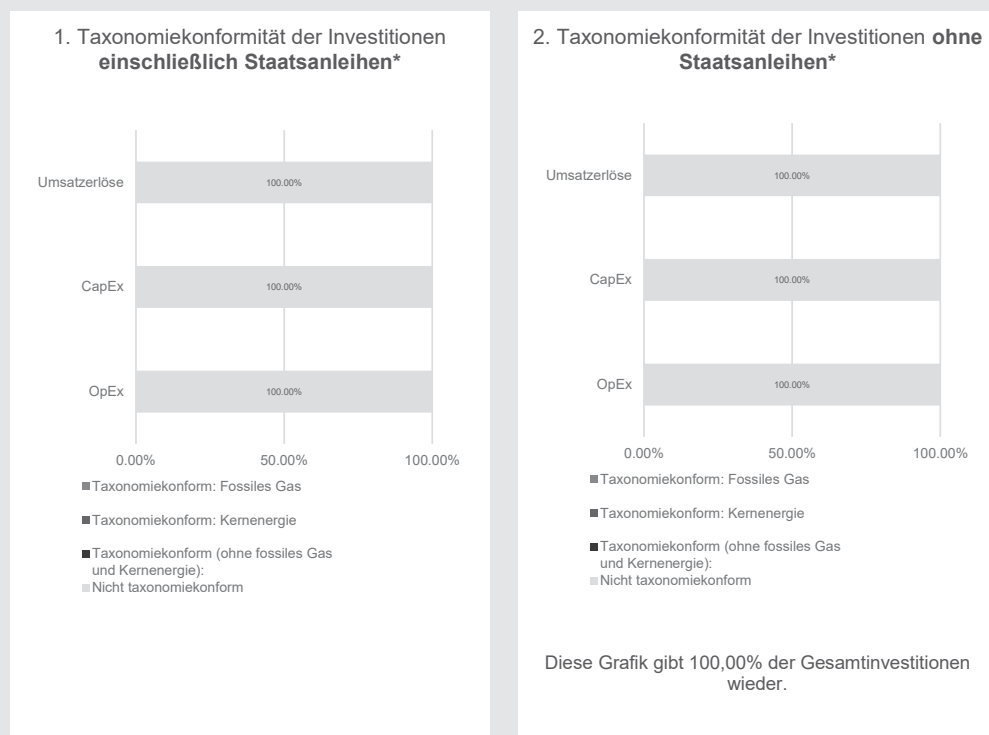
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 16,77 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 50,60 %.



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 0,72 % 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 bei Portfoliounternehmen zu Themen wie Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien, Pläne des Unternehmens zum Übergang auf netto Null CO₂-Emissionen und Unternehmenskultur.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf unternehmenseigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und sonstigen ausgeschlossenen 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 mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher 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



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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

- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 77,78% 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
- ☐ Es wurden damit 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 umstrittenen 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?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

Wie im eigenen Rahmen der Anlageverwaltung auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 81,41 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

sozialen Merkmale erreicht werden.

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 65 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftsbasierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 7 % 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 fünfmal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien und Risiken in Bezug auf den Klimawandel besprochen. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Insgesamt fanden im Berichtszeitraum 31 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 dienen 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, die auf der Grundlage der Annahme wissenschaftsbasierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2025	2024
	Wert	Wert
Interventionen: 1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%	0,00%
Interventionen: 2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%	0,00%
Interventionen: 3. Diskussion zu den Problemen findet statt	0,00%	100,00%
Interventionen: 4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	100,00%	0,00%
Interventionen: 5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	0,00%	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	64,80%	62,30%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	6,50%	19,60%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	15,80%	8,30%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	12,90%	9,80%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO ₂ e	14 847,94	99,19%	14 201,20	99,16%	12 594,31	96,22%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	159,50	99,19%	76,46	99,16%	71,95	96,22%
THG- Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	782,06	99,43%	386,71	98,50%	416,67	96,22%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,43%	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	51,08%	99,43%	k. A.	k. A.	70,31%	82,33%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,22	99,43%	0,32	87,07%	0,31	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	99,43%	0,02	87,07%	0,02	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	99,43%	0,00	87,07%	0,00	93,16%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	15,59%	99,19%	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,01	5,04%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,10	99,19%	0,05	45,55%	0,09	47,76%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,43%	0,00%	99,16%	0,00%	98,99%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,24%	99,43%	39,84%	97,88%	50,36%	95,15%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	13,66%	70,20%	19,20%	28,93%	19,03%	11,63%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	39,94%	99,43%	38,14%	97,88%	35,94%	96,22%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,43%	0,00%	97,88%	0,00%	96,22%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Anteil des Fonds-Nettoinventarwerts, der in Unternehmen mit einem wissenschaftsbasierten Ziel investiert ist, stieg gegenüber dem Ende des vorherigen Berichtszeitraums von 62 % auf 65 %. Im selben Zeitraum ging der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftsbasierter Ziele verpflichtet haben, von 20 % auf 7 % zurück. Das ist auf Veränderungen in den Portfoliobeständen und darauf zurückzuführen, dass sich die Verpflichtungen der Unternehmen auflösten, ohne dass konkrete Ziele festgelegt wurden.

Im Vergleich zum vorherigen Berichtszeitraum ging der Austausch zu ESG-Themen mit dem Ziel der Einflussnahme auf das Verhalten der Unternehmen leicht zurück. Die Zahl der Interventionen sank von 5 auf 4. Insgesamt stieg die Zahl der Interventionen von 22 auf 31.

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 die Anlageverwaltung 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 des DNSH-Prinzips 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 einem hohen und nicht kontrollierten CO₂-Fußabdruck in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 von der Anlageverwaltung zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflusst haben. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings

Bei den wichtigsten nachhaltigen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachhaltigen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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?

Die Anlageverwaltung berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 verpflichtenden PAI-Indikatoren und zwei optionale Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo die Anlageverwaltung potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung 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, welche 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 die Anlageverwaltung 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. Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat die Anlageverwaltung mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik der Anlageverwaltung ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 verpflichtenden PAI und der beiden optionalen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Die Anlageverwaltung 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-Fußabdruck) 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 Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) 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
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik der Anlageverwaltung in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie der Anlageverwaltung für verantwortliches Investieren.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Ferrari N.V.	Zyklische Konsumgüter	9,39%	Italien
ASML Holding N.V.	Informationstechnologie	7,89%	Niederlande
MONCLER S.P.A.	Zyklische Konsumgüter	6,38%	Italien
LINDE PUBLIC LIMITED COMPANY	Grundstoffe	5,21%	Vereinigtes Königreich
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	4,98%	Frankreich
NOVO NORDISK A/S	Gesundheitssektor	4,97%	Dänemark
Partners Group Holding AG	Finanzsektor	4,92%	Schweiz
Atlas Copco Aktiebolag	Industrie	4,75%	Schweden
NEMETSCHEK SE	Informationstechnologie	4,70%	Deutschland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

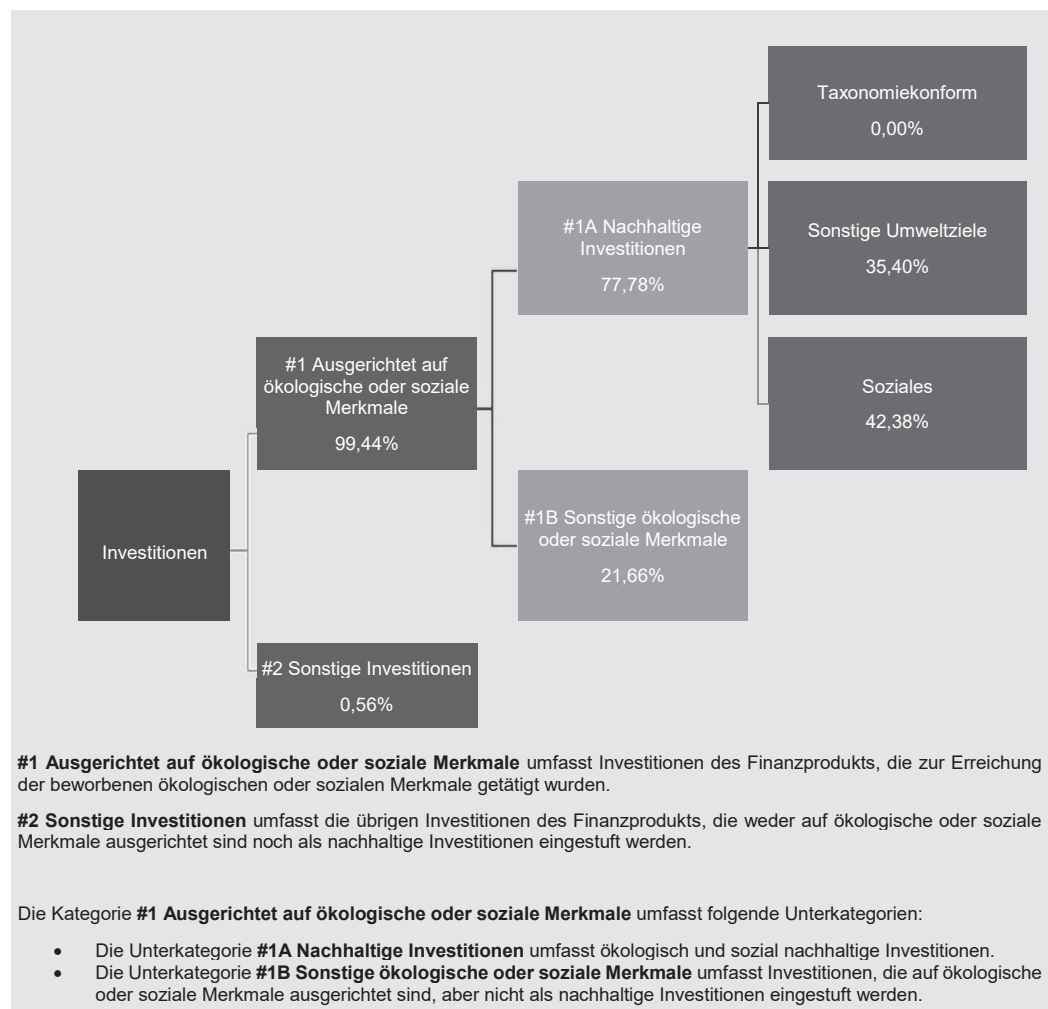
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 77,78 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,44 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,56 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 77,78 % in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,44%	99,16%	99,00%
#2 Sonstige Investitionen	0,56%	0,84%	1,00%
#1A Nachhaltige Investitionen	77,78%	75,27%	76,00%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	21,66%	23,89%	23,00%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	35,40%	34,93%	36,00%
Soziales	42,38%	40,34%	40,00%

● **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	In % der Vermögenswerte
Informationstechnologie	24,15%
Gesundheitssektor	19,99%
Zyklische Konsumgüter	17,38%
Industrie	15,27%
Finanzsektor	8,98%
Grundstoffe	7,24%
Basiskonsumgüter	6,41%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	12,43%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	10,30%
Automobilindustrie	9,39%
Baustoffe	9,19%
Software	8,35%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	7,99%
Chemische Erzeugnisse	7,24%
Pharmaindustrie	6,01%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,98%
Kapitalmärkte	4,92%
Maschinen	4,75%
Finanzdienstleistungen	4,06%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	3,69%
Elektrogeräte, Instrumente und Komponenten	3,37%
Getränke	1,43%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



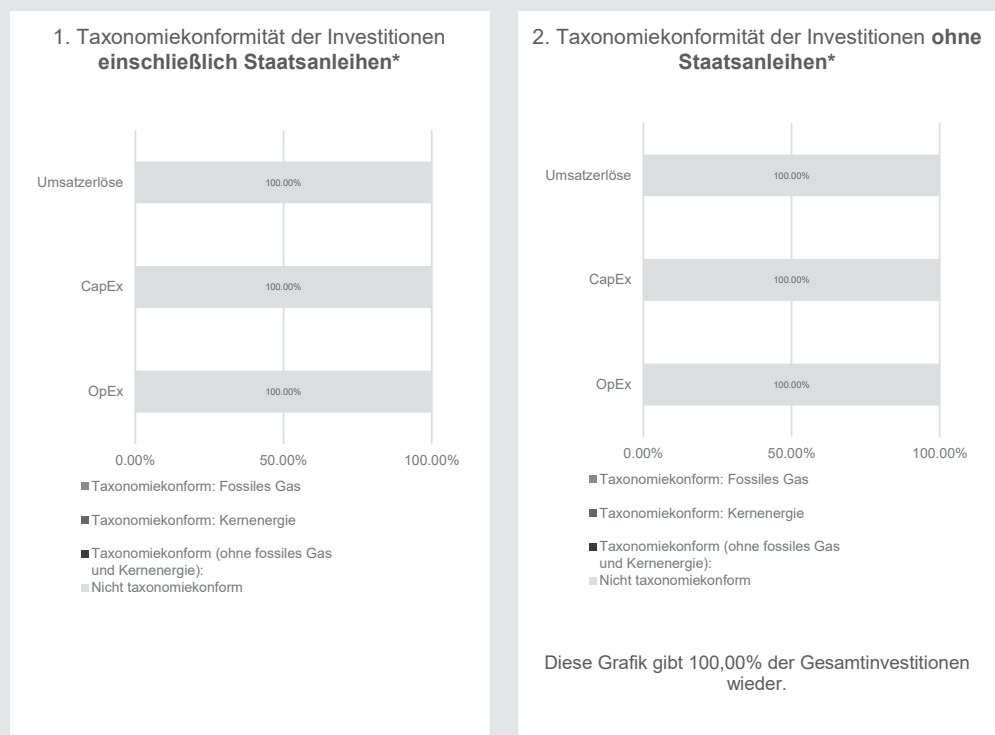
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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 Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 35,40 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 42,38 %.



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 0,56 % 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 bei Portfoliounternehmen zu Themen wie Zusammensetzung der Leitungs- und Kontrollgremien und Gefahren des Klimawandels.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf unternehmenseigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle sonstigen ausgeschlossenen 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 mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher 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 (Aktien von Unternehmen, die in Europa ansässig oder börsennotiert sind, oder die ihre Geschäfte vorwiegend in Europa tätigen).



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen 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**

☒ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 12,05%

☐ 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

☒ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 86,10%

☐ **NEIN**

☐ Es wurden damit **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

☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.



Inwieweit wurde das nachhaltige Investitionsziel dieses Finanzprodukts erreicht?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die nachhaltigen Ziele dieses Finanzprodukts erreicht werden.

Zur Erreichung des Ziels nachhaltiger Investitionen des Fonds stellen die Unternehmen, in die investiert wird, Waren 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 28. Februar 2025 waren 97,80 % des verwalteten Fondsvermögens in Unternehmen investiert, die einen Beitrag zum Ziel der nachhaltigen Investition leisten. Die restlichen 2,20 % wurden in liquiden Mitteln gehalten.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung des Ziels der nachhaltigen Investition des Fonds festgelegt.

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 die Anlageverwaltung für bestimmte KPIs des Unternehmens einsetzt, und

- Schwerpunkt auf der Verbesserung des Verhaltens im Bereich der Nachhaltigkeit.

Während der Haltedauer jedes Titels war der Fonds zu 100 % in mindestens einem der vorgenannten Bereiche engagiert.

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, die auf der Grundlage der Annahme wissenschaftsbasierter Ziele festgelegt wurden. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2025	2024
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert
Wirkungsbezogene KPIs: Erfüllung	60,80%	k. A.
Wirkungsbezogene KPIs: Überschreitung	19,60%	k. A.
Wirkungsbezogene KPIs: Unterschreitung	19,60%	k. A.
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erreichung des Netto-Null-Ziels	0,00%	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf Netto-Null-Ziel ausgerichtet	6,30%	0,00%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Auf dem Weg zur Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel	26,10%	32,90%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Verpflichtet	17,40%	24,90%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Erste Klimaschutzmaßnahmen	12,70%	5,20%
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel laut MC: Keine Maßnahmen	35,40%	35,20%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Gegenüber dem vorhergehenden Berichtszeitraum ging der Anteil unternehmensspezifischer KPIs, die unsere Erwartungen erfüllen, zurück. Zudem stieg der Anteil der KPIs, die in ihrer Entwicklung die vorherige Periode übertrafen oder dahinter zurückblieben, leicht an. Dass allerdings mehr als 80 % der KPIs zum Ende des Berichtszeitraums in die Kategorie „erfüllt“ oder „übertrifft“ eingestuft wurden, ist aus unserer Sicht ein Zeichen für die Erreichung des nachhaltigen Investitionsziels.

Gegenüber dem vorherigen Berichtszeitraum ist der Anteil derjenigen Unternehmen, die das Netto-Null-Ziel einhielten, gestiegen – sie haben beim Erreichen der selbst gesteckten CO₂-Reduktionsziele Fortschritte gemacht. Dies zeigt sich in einem Rückgang des Anteils der Unternehmen „Auf dem Weg zur Ausrichtung auf das Netto-Null-Ziel“ (die sich ein Ziel gesetzt haben, aber noch nicht auf dem Weg sind, es zu erreichen). Der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftsbasierter Ziele verpflichtet haben, ist zurückgegangen, der Anteil derjenigen, die erste Klimaschutzmaßnahmen ergreifen, jedoch gestiegen. Diese Entwicklung ist teilweise gewissen Hemmnissen geschuldet, die Unternehmen am Abschluss ihrer Ziele nach erfolgter Verpflichtung hindern. Die Unternehmen in der Kategorie „erste Klimaschutzmaßnahmen“ arbeiten weiter an der Verringerung ihres Emissionsprofils. Der Anteil der Unternehmen in der Kategorie „keine Maßnahmen“ blieb gegenüber dem vorherigen Zeitraum weitgehend gleich.

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 die Anlageverwaltung 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 (UNG) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktor

2. Durch eine Bewertung des DNSH-Prinzips 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 einem hohen und nicht kontrollierten CO₂-Fußabdruck in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 von der Anlageverwaltung 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.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Anlageverwaltung berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 verpflichtenden PAI-Indikatoren und zwei optionale Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo die Anlageverwaltung potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung 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. Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat die Anlageverwaltung mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik der Anlageverwaltung ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung 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 der Anlageverwaltung für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 verpflichtenden PAI und der beiden optionalen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Die Anlageverwaltung 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-Fußabdruck) 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 Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)),

- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) 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
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik der Anlageverwaltung in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie der Anlageverwaltung für verantwortliches Investieren.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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:
01.03.2024 – 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
MercadoLibre, Inc.	Zyklische Konsumgüter	6,83%	Uruguay
INTUITIVE SURGICAL, INC.	Gesundheitssektor	6,66%	USA
XYLEM INC.	Industrie	5,74%	USA
NOVOZYMES A/S	Grundstoffe	5,03%	Dänemark
HDFC BANK LIMITED	Finanzsektor	5,02%	Indien
REVVITY, INC.	Gesundheitssektor	5,01%	USA
VALMONT INDUSTRIES, INC.	Industrie	4,95%	USA
ECOLAB INC.	Grundstoffe	4,84%	USA
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	Versorgungsunternehmen	4,33%	Frankreich
AIRTEL AFRICA PLC	Kommunikationsdienste	4,06%	Vereinigtes Königreich



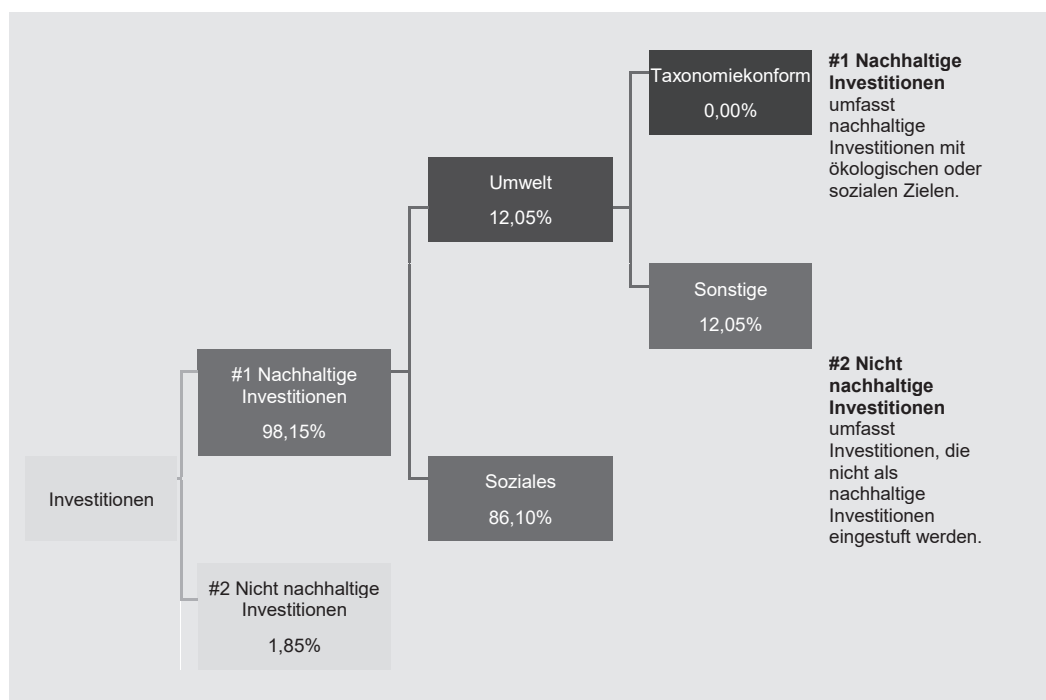
Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 98,15 %.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,15 % des Fonds-Nettoinventarwerts wurden in nachhaltige Anlagen investiert. Der verbleibende Teil (1,85 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.



	Asset-Allocation im historischen Vergleich	
	2025	2024
Anlagekategorie	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Nachhaltige Investitionen	98,15%	96,90%
#2 Nicht nachhaltige Investitionen	1,85%	3,10%
Umwelt	12,05%	14,80%
Soziales	86,10%	82,10%
Taxonomiekonform	k.A	k.A
Sonstige	12,05%	14,80%

● **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	In % der Vermögenswerte
Gesundheitssektor	23,61%
Industrie	19,48%
Zyklische Konsumgüter	17,60%
Grundstoffe	12,97%
Finanzsektor	6,98%
Informationstechnologie	6,89%
Versorgungsunternehmen	6,52%
Kommunikationsdienste	4,06%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Chemische Erzeugnisse	12,97%
Maschinen	10,63%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	8,15%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	7,83%
Banken	6,98%
Allgemeiner Einzelhandel	6,83%
Bau- u. Ingenieurwesen	4,95%
Multi-Versorger	4,33%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	4,06%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	3,91%
Software	3,89%
Gesundheitstechnologie	3,84%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,78%
Langlebige Haushaltsgüter	2,87%
Fachdienstleistungen	2,74%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



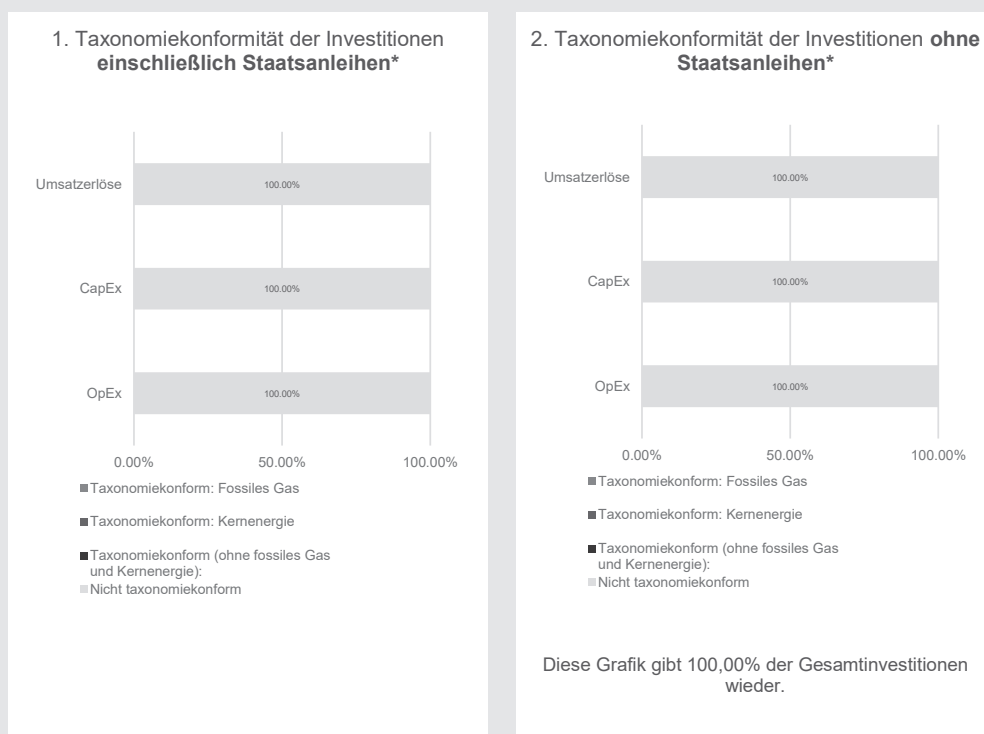
Inwiefern wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht?

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 Kernenergie¹

- ☐ Ja
- ☐ In fossiles Gas ☐ In Kernenergie
- ☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden.



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.

Wie hoch ist 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 EU-Taxonomie nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestanden im Referenzzeitraum 12,05 % des Fonds aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug im Referenzzeitraum 86,10 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,85 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung des nachhaltigen Investitionsziels ergriffen?

Während der Haltedauer einzelner Portfoliotitel sprachen die PortfoliomanagerInnen mit den Portfoliounternehmen über die von ihnen durch ihre Waren und Dienstleistungen erzielten Auswirkungen oder über die Verbesserung ihres Verhaltens im Bereich der Nachhaltigkeit.

Alle im Verkaufsprospekt genannten verbindlichen Elemente 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.



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 nachhaltige Ziel des Finanzprodukts erreicht wird.

Franklin Responsible Income 2028 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900FTK4TK4QA6CU84



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,76% 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
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu fördern hat das Team des Portfoliomanagements Engagements in so genannten „Klima-Nachzügler“ 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 Fonds in Klima-Nachzügler bei 0 % seines Nettoinventarwerts (NIW) im Referenzzeitraum.

Zudem hat der Fonds 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 Fonds auch nicht in staatliche Emittenten investiert, die nach dem Freedom House Index als „nicht frei“ eingestuft werden.

Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines Vermögens in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen (mindestens 10 %), und zu sozialen Zielen (mindestens 1 %) beitragen.

Im Berichtszeitraum vom 1. März 2024 bis 28. Februar 2025 übertraf der Fonds diese Zusagen: In den vier Quartalen war ein gewichteter Durchschnitt von 18,76 % seines Nettoinventarwerts nachhaltig investiert. Davon waren 13,24 % Investments in Aktivitäten, die zu ökologischen Zielen beitragen und 5,52 % in Aktivitäten, die zu sozialen Zielen beitragen. Diese Allokationen erfolgten vor allem mittels Investments in Anleihen mit vorgegebener Mittelverwendung im grünen, sozialen und nachhaltigen Bereich, die ausdrücklich zur Finanzierung zulässiger Umwelt- und/oder Sozialprojekte emittiert wurden.

Ein Beispiel hierfür ist das Investment des Fonds in eine Anleihe der Republik Island, bei der die Verwendung der Mittel zur Unterstützung von Umwelt- und Sozialprojekten vorgegeben war. Die nachhaltigen Anlageleitlinien des Emittenten konzentrieren sich auf Schlüsselbranchen wie erneuerbare Energie, sauberes Transportwesen und soziale Prioritäten wie unter anderem Bildung, Gesundheitswesen und Wohlergehen. Die Breite und strategische Anpassung der Leitlinien hinterließ einen sehr positiven Eindruck.

In dieser Hinsicht hatte der gewichtete Durchschnitt über die vier Quartale im vorgenannten Berichtszeitraum zur Folge, dass 99,45 % des Fondsvermögens mit den ökologischen und sozialen Merkmalen (E/S) übereinstimmten. Die verbleibenden 0,55 % (ebenfalls auf Grundlage des gewichteten Durchschnitts) waren liquide Mittel und Derivate, die diesen Merkmalen nicht entsprachen.

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.

– 13,24 % Anlagen in grünen Anleihen

– 5,52 % Anlagen in sozialen Anleihen

– 0,00 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen

– 36,49 % 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 %

Die Anlageverwaltung stand zwischen dem 1. März 2024 und dem 28. Februar 2025 mit folgenden Emittenten im Austausch:

1. ABERTIS INFRAESTRUCTURAS
2. ABN AMRO BANK NV
3. ADEVINTA ASA
4. AIB GROUP PLC
5. ALTICE FRANCE SA
6. ARENA LUX FIN SARL
7. AUTOSTRADA PER LITALIA
8. AVANTOR FUNDING INC
9. AYVENS SA
10. AZELIS FINANCE NV
11. BANCO DE SABADEL SA
12. BANK OF IRELAND GROUP
13. BARCLAYS PLC
14. BARRY CALLEBAUT SVCS NV
15. BAWAG P.S.K.
16. BERRY GLOBAL INC
17. BNP PARIBAS
18. BONOS Y OBLIG DEL ESTADO
19. BPCE SA
20. CAB
21. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS
22. CAIXABANK SA
23. CARRIER GLOBAL CORP
24. CESKA SPORITELNA AS
25. CEZ AS
26. CLOVERIE PLC ZURICH INS
27. COMMERZBANK AG
28. COOPERATIEVE RABOBANK UA
29. COTY INC
30. CREDIT AGRICOLE SA
31. CRELAN SA
32. CROWN EURO HOLDINGS SA

33. DANSKE BANK A/S
34. DEUTSCHE LUFTHANSA AG
35. DSV FINANCE BV
36. DXC CAPITAL FUNDING LTD
37. EASYJET FINCO BV
38. ENGIE SA
39. GOLDMAN SACHS GROUP INC
40. H LUNDBECK A/S
41. HOLDING DINFRASTRUCTURE
42. IBERCAJA BANCO SA
43. ILIAD HOLDING SAS
44. ILIAD SA
45. IMA INDUSTRIA MACCHINE
46. ING GROEP NV
47. INTESA SANPAOLO SPA
48. IQVIA INC
49. ITALMATCH CHEMICALS SPA
50. JPMORGAN CHASE & CO
51. LA BANQUE POSTALE
52. LKQ EURO HOLDINGS BV
53. LOGICOR FINANCING SARL
54. MACQUARIE GROUP LTD
55. MATTERHORN TELECOM SA
56. MORGAN STANLEY
57. MOTABILITY OPERATIONS GR
58. MUNDYS SPA
59. NATIONAL GRID PLC
60. NATIONWIDE BLDG SOCIETY
61. NATWEST MARKETS PLC
62. NTT FINANCE CORP
63. NYKREDIT REALKREDIT AS
64. OP CORPORATE BANK PLC
65. ORANO SA
66. OTP BANK NYRT
67. PAPREC HOLDING SA
68. PROSUS NV
69. PRYSMIAN SPA
70. PVH CORP
71. RCI BANQUE SA
72. REPUBLIC OF ICELAND
73. REXEL SA
74. RUMĂNIEN
75. SAGE GROUP PLC (THE)
76. SANTANDER UK GROUP HLDGS
77. SCHNEIDER ELECTRIC SE
78. SKANDINAVISKA ENSKILDA
79. SOCIETE GENERALE
80. SVENSKA HANDELSBANKEN AB
81. SWEDBANK AB
82. TDF INFRASTRUCTURE SAS
83. TEAMSYSTEM SPA
84. TENNET HOLDING BV

85. THERMO FISHER SCIENTIFIC
86. UBS GROUP AG
87. UNICAJA BANCO SA
88. US BANCORP
89. VERISURE HOLDING AB
90. VERIZON COMMUNICATIONS
91. VICTORIA PLC
92. VOLVO CAR AB
93. WERFEN SA/SPAIN

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert
Engagement in grünen Anleihen	13,24%	11,24%	12,98%
Engagement in sozialen Anleihen	5,52%	4,48%	4,59%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%	0,00%	0,00%
Engagement in Umweltchampions	36,49%	41,10%	34,59%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%	0,00%	0,00%
Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren)	1,00	1,00	1,00
Liste der Emittenten, mit denen die Anlageverwaltung zusammenarbeitet	93,00	1,00	1,00

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	3 465,21	80,22%	3 138,53	71,04%	1 109,46	64,71%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	317,59	80,22%	310,51	71,04%	144,52	64,71%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	16 003,08	81,10%	14 877,17	71,04%	6 075,57	64,71%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	3 782,80	80,22%	3 449,04	71,04%	1 253,97	64,71%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	19 785,89	81,10%	18 392,29	71,04%	7 329,55	64,71%
CO ₂ -Fußabdruck 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	57,79	80,21%	57,62	71,04%	53,15	64,71%
CO ₂ -Fußabdruck (Schätzung, EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	296,33	81,10%	310,66	71,04%	310,66	64,71%
THG-Emissionsintensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	76,14	89,29%	74,78	88,21%	492,67	88,86%
Geschätzte THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	578,06	90,17%	749,46	88,37%	1 196,48	88,86%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,96%	88,42%	4,32%	84,69%	5,14%	81,11%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	60,06%	85,76%	64,38%	67,18%	62,08%	75,68%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,15	83,12%	0,18	65,27%	0,43	6,87%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	3,68	83,12%	8,66	65,27%	11,63	5,14%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,12	83,12%	0,09	65,27%	0,06	0,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,03	83,12%	0,03	65,27%	0,03	1,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,41	83,12%	0,47	65,27%	0,11	1,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,24%	88,43%	0,00%	84,69%	0,00%	81,11%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,00%	0,00	0,00%	0,03	3,44%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,24	77,82%	0,45	14,85%	0,09	12,86%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,80%	0,00%	86,53%	0,00%	81,11%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,00%	87,87%	26,14%	84,69%	0,00%	81,11%

		PAI im historischen Vergleich					
		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	15,94%	63,56%	23,02%	29,76%	27,51%	20,65%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	38,37%	87,62%	37,87%	84,69%	38,31%	81,11%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	88,42%	0,00%	84,69%	0,00%	81,11%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	320,56	3,93%	481,28	0,02%	481,28	2,32%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	3,93%	0,00	0,02%	0,00	2,32%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Wir weisen darauf hin, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren für diesen Bezugszeitraum (Umweltchampions, Prozentsatz der Investitionen in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen und PAIs) nun auf den Durchschnittswerten zum Ende jedes Quartals basieren. Die Daten für den vorhergehenden Bezugszeitraum per Ende des Geschäftsjahrs am 29. Februar 2024 in den oben aufgeführten Tabellen zeigen hingegen nur die Werte an diesem Stichtag. Diese methodischen Unterschiede erschweren daher den aussagekräftigen Vergleich zwischen den beiden Bezugszeiträumen.

Unsere AnlageverwalterInnen waren im gesamten Bezugszeitraum nach wie vor sehr aktiv und standen vermehrt im intensiven Austausch mit Unternehmen. Dabei konnten sie die Anzahl der Unternehmen, die sie so begleiteten, von 72 auf 93 steigern.

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:

- der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- der sozialen Integration,
- guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- 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:

- Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- 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
- 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:

- Erlöse für geeignete Sozialprojekte genutzt wurden,
- 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?

Die Anlageverwaltung 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 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Emissionsintensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) (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, 18,76 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden wie folgt verwendet:

- 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 siehe die Abschnitte „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie“ des Fonds in diesem Anhang).

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 die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie 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:

Auf 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 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, welche 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 von der Anlageverwaltung 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 im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 01.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Government of Romania 2.125% 07-MAR-2028	Staatsanleihen	2,11%	Rumänien
NatWest Markets Plc 4.25% 13-JAN-2028	Finanzsektor	1,79%	Vereinigtes Königreich
ENGIE SA. 1.75% 27-MAR-2028	Versorgungsunternehmen	1,74%	Frankreich
Intesa Sanpaolo S.p.A. 1.75% 20-MAR-2028	Finanzsektor	1,74%	Italien
UBS Group AG 4.625% 17-MAR-2028	Finanzsektor	1,72%	Schweiz
OP Yrityspankki Oyj 0.375% 16-JUN-2028	Finanzsektor	1,65%	Finnland
National Grid plc 0.163% 20-JAN-2028	Versorgungsunternehmen	1,65%	Vereinigtes Königreich
JPMorgan Chase & Co. 1.638% 18-MAY-2028	Finanzsektor	1,64%	USA
Bank of Ireland Group plc 4.875% 16-JUL-2028	Finanzsektor	1,64%	Irland
ABN AMRO Bank N.V. 4.0% 16-JAN-2028	Finanzsektor	1,62%	Niederlande
Abertis Infraestructuras, S.A. 4.125% 31-JAN-2028	Industrie	1,62%	Spanien
Societe Generale SA 0.125% 18-FEB-2028	Finanzsektor	1,62%	Frankreich
Barclays PLC 0.877% 28-JAN-2028	Finanzsektor	1,61%	Vereinigtes Königreich
Sage Group plc 3.82% 15-FEB-2028	Informationstechnologie	1,61%	Vereinigtes Königreich
CaixaBank, S.A. 0.75% 26-MAY-2028	Finanzsektor	1,60%	Spanien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

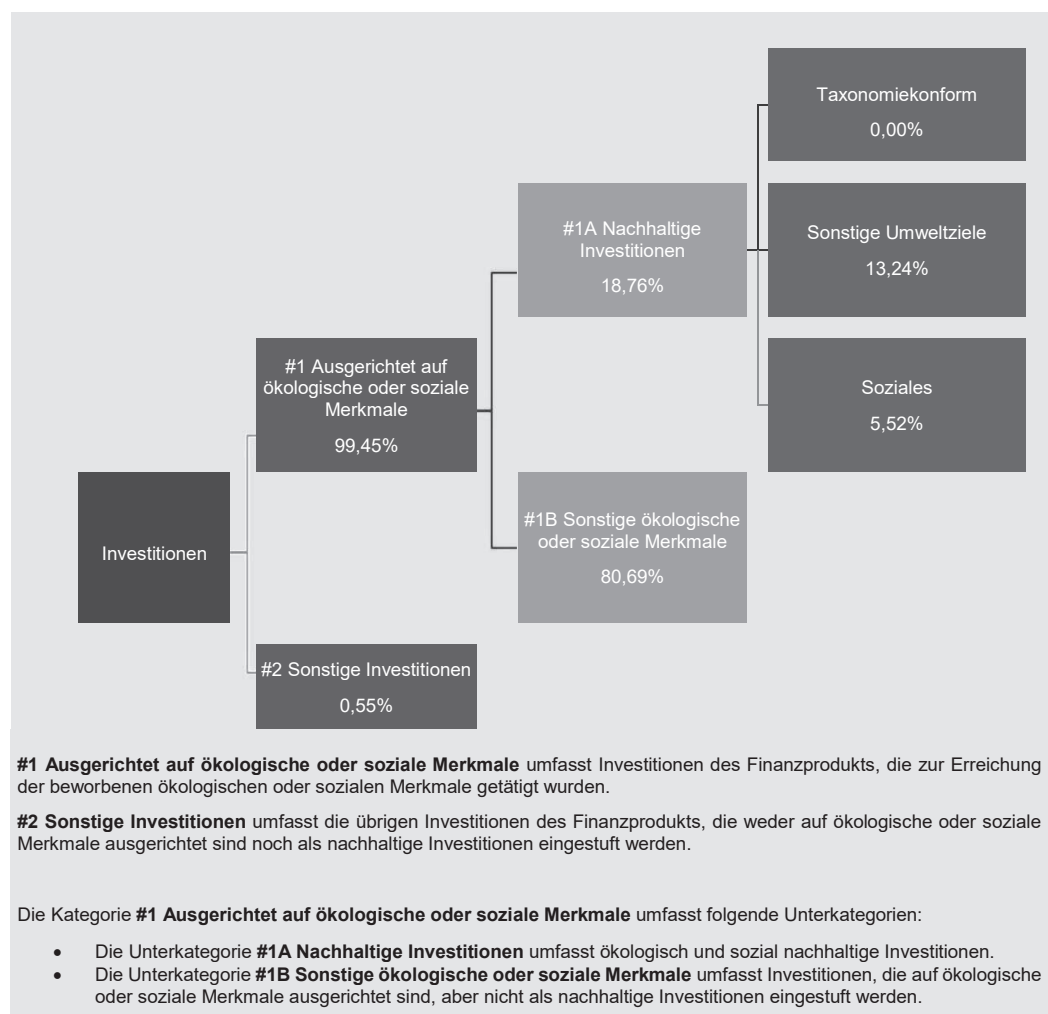
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 18,76 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,45 % des Fondsportfolios 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 (0,55 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 18,76 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



Anlagekategorie	Asset-Allocation im historischen Vergleich		
	2025	2024	2023
Anlagekategorie	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,45%	98,56%	96,35%
#2 Sonstige Investitionen	0,55%	1,44%	3,65%
#1A Nachhaltige Investitionen	18,76%	15,72%	17,58%
#1B Sonstige ökologische oder soziale Merkmale	80,69%	82,84%	78,77%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	13,24%	11,24%	12,98%
Soziales	5,52%	4,48%	4,59%

● **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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	56,10%
Industrie	13,07%
Zyklische Konsumgüter	6,19%
Gesundheitssektor	5,52%
Versorgungsunternehmen	5,42%
Staatsanleihen	3,93%
Informationstechnologie	3,65%
Grundstoffe	2,40%
Kommunikationsdienste	1,75%
Immobilien	1,27%
Basiskonsumgüter	0,16%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Banken	40,31%
Kapitalmärkte	7,39%
Finanzdienstleistungen	7,26%
Staatsanleihen	3,93%
Multi-Versorger	3,40%
Elektrogeräte	2,76%
Verkehrsinfrastruktur	2,62%
Passagierfluggesellschaften	2,55%
Überlandtransport	2,23%
Software	2,22%
Automobilindustrie	2,16%
Stromversorger	2,02%
Behälter u. Verpackungen	1,88%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	1,51%
Pharmaindustrie	1,47%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



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

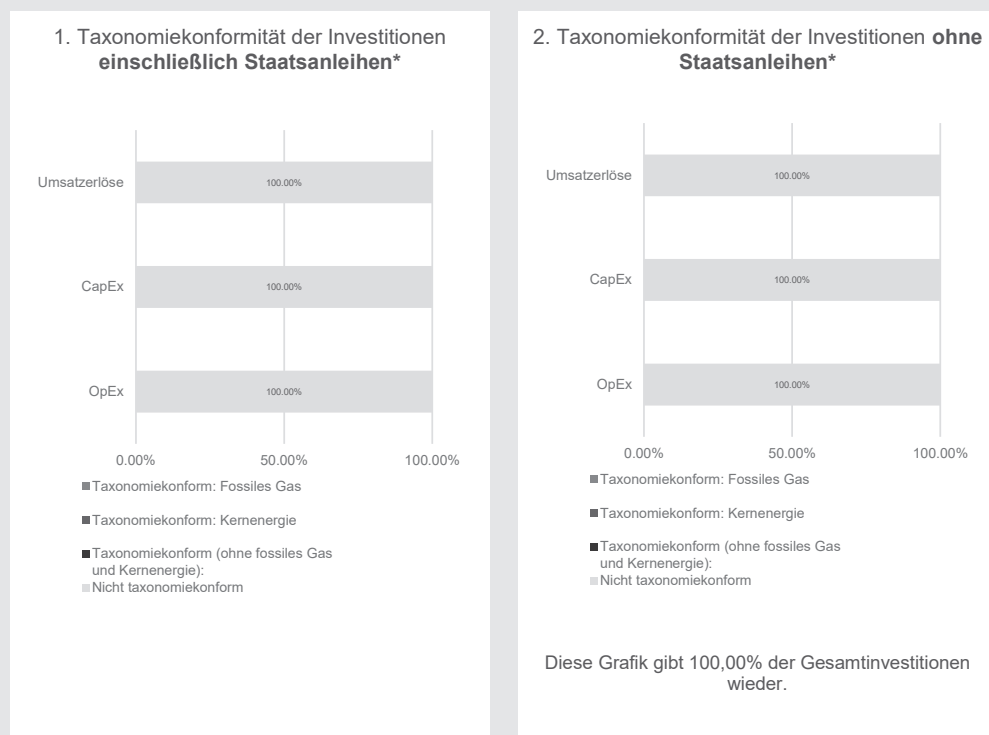
☐ Ja

☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.



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?

13,24 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 5,52 %.



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 „#2 Andere Investitionen“ lag bei 0,55 % 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. Die Anlageverwaltung 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 AnlagerverwalterInnen, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine unternehmenseigene Methode des ESG-Rating 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 AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen 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 die Anlageverwaltung überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung 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 die Anlageverwaltung 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.

Fiele ein vom Fonds gehaltenes Wertpapier unter mindestens einen der oben genannten Ausschlüsse, würde der Anlageverwalter/die Anlagerverwalterin dieses Wertpapier schnellstmöglich, spätestens jedoch nach sechs Monaten, abstoßen.

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 (UNGC) und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen (PAI Nr. 10),
- ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen (PAI Nr. 14),
- mit Standorten/Betrieben in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, die in Kontroversen mit schweren nachteiligen Auswirkungen auf diese Gebiete involviert 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, mindestens 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüfen die AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüfen die AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen 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 PortfoliomanagerInnen verdeutlichen.

- Der Dialog fand in einem eigens vereinbarten Einzelgespräch mit der Bank of Ireland Group im Dezember 2024 statt. Die ESG-Strategie des Konzerns ruht auf drei zentralen Säulen: Voranbringen des grünen Wandels, Stärkung des gesellschaftlichen Engagements und Pflege des positiven Miteinanders bei den Beschäftigten. Die AnlagerverwalterInnen wollten sich umfassender über die Umweltstrategie des Konzerns und die Pläne für die anstehenden Offenlegungen informieren. In den Gesprächen wurde die Ausweitung seines Konzepts über Treibhausgasemissionen hinaus unterstrichen, das künftig auch Biodiversität und Wasserqualität umfassen soll. Der Emittent bezog sich auf seine Überwachung nationaler Indikatoren, unter anderem jener der Irish Environmental Protection Agency. Die AnlagerverwalterInnen begrüßten die Maßnahmen zur Unterstützung von Landwirten durch gezielte Schulungen und Anreizmodelle und nahmen die Verpflichtung des Konzerns zur Kenntnis, seine Zahlen zur Konformität mit der EU-Taxonomie für 2024 im Februar 2025 zu veröffentlichen. Im Dialog wurden auch soziale Aspekte angesprochen wie die Anstrengungen des Konzerns zu Diversität und Inklusion. Der Emittent hat nach eigenen Angaben auf Ebene der Leitungs- und Kontrollgremien – im Einklang mit der irischen Gesetzgebung zur Lohngleichheit – Geschlechterparität erreicht. Gleichzeitig setzt er auf inklusive Maßnahmen wie Vaterschaftsurlaub und Unterstützung von Initiativen im Bereich Neurodiversität.
- Im Rahmen dieser Anstrengungen kontaktierte die Anlageverwaltung auch Emittenten, deren Performance bei den verpflichtenden PAI-Indikatoren im Referenzzeitraum 2024 insgesamt unterdurchschnittlich geblieben war. So gab es zum Beispiel ein Meeting mit den VertreterInnen der Republik Rumänien. Bei diesem Gespräch ermutigten die AnlagerverwalterInnen den Emittenten, die Ausgabe weiterer Instrumente mit festgelegter Mittelverwendung in Erwägung zu ziehen und dadurch Rumäniens Energiewende-Strategie zu unterstützen sowie weitere ökologische Herausforderungen wie das nachhaltige Wassermanagement anzugehen.



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.

Franklin Responsible Income 2029 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900HN2FBZVQ2RSC08



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 Portfoliounternehmen Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die EU-Taxonomie ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von ökologisch nachhaltigen 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

- ☐ Es wurden damit 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
- ☐ Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: 0,00%

☒ NEIN

- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 27,56% 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
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu fördern hat das Team des Portfoliomanagements Engagements in so genannten „Klima-Nachzügler“ 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 Fonds in Klima-Nachzügler bei 0 % seines Nettoinventarwerts (NIW) im Referenzzeitraum.

Zudem hat der Fonds 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 Fonds auch nicht in staatliche Emittenten investiert, die nach dem Freedom House Index als „nicht frei“ eingestuft werden.

Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines Vermögens in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen (mindestens 10 %), und zu sozialen Zielen (mindestens 1 %) beitragen.

Im Berichtszeitraum vom 1. März 2024 bis 28. Februar 2025 übertraf der Fonds diese Zusagen: In den vier Quartalen war ein gewichteter Durchschnitt von 27,56 % seines Nettoinventarwerts nachhaltig investiert. Davon waren 26,10 % Investments in Aktivitäten, die zu ökologischen Zielen beitragen und 1,46 % in Aktivitäten, die zu sozialen Zielen beitragen. Diese Allokationen erfolgten vor allem mittels Investments in Anleihen mit vorgegebener Mittelverwendung im grünen, sozialen und nachhaltigen Bereich, die ausdrücklich zur Finanzierung bestimmter zulässiger Umwelt- oder Sozialprojekte emittiert wurden.

Ein Beispiel für diese Zusagen ist das Investment des Fonds in eine Anleihe der Swedbank AB, bei der die Verwendung der Mittel zur Unterstützung von Umwelt- und Sozialprojekten vorgegeben war. Die nachhaltigen Anlageleitlinien des Emittenten konzentrieren sich auf Schlüsselbranchen wie erneuerbare Energie und Energieeffizienz sowie soziale Prioritäten wie unter anderem die Verringerung von Ungleichheiten und die Bekämpfung von Armut. Die Swedbank ist eine herausragende Bank, die die Energiewende aktiv vorantreibt. Darin unterscheidet sie sich von anderen, die noch immer stark in die Finanzierung fossiler Brennstoffe involviert sind. In dieser Hinsicht hatte der gewichtete Durchschnitt über die vier Quartale im vorgenannten Berichtszeitraum zur Folge, dass 97,66 % des Fondsvermögens mit den ökologischen und sozialen Merkmalen (E/S) übereinstimmen. Die verbleibenden 2,34 % (ebenfalls auf Grundlage des gewichteten Durchschnitts) waren liquide Mittel und Derivate, die diesen Merkmalen nicht entsprachen.

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.

- 26,10 % Anlagen in grünen Anleihen,
- 1,46 % Anlagen in sozialen Anleihen,
- 0,00 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen
- 27,77 % 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 %

Die Anlageverwaltung stand zwischen dem 1. März 2024 und dem 28. Februar 2025 mit folgenden Emittenten im Austausch:

1. ABANCA CORP BANCARIA SA
2. ABERTIS INFRAESTRUCTURAS
3. AIB GROUP PLC
4. AIR FRANCE-KLM
5. AYVENS SA
6. ALSTOM SA
7. AMBER FINCO PLC
8. APTIV PLC
9. ARGENTA SPAARBANK
10. AROUNDTOWN SA
11. AUTOSTRADA PER LITALIA
12. AVANTOR FUNDING INC
13. AZELIS FINANCE NV
14. BANCA TRANSILVANIA
15. BANCO DE SABADELL SA
16. BANCO SANTANDER SA
17. BANIJAY ENTERTAINMENT
18. BANK OF IRELAND GROUP
19. BANQUE FED CRED MUTUEL
20. BARRY CALLEBAUT SVCS NV
21. BFF BANK SPA
22. BIRKENSTOCK FINANC SARL
23. BLACKSTONE PP EUR HOLD
24. BNP PARIBAS
25. BPCE SA
26. BUONI POLIENALI DEL TES
27. CAIXA GERAL DE DEPOSITOS
28. CAIXABANK SA
29. CAPITAL ONE FINANCIAL CO
30. CARNIVAL PLC
31. CATALENT PHARMA SOLUTION
32. CELLNEX TELECOM SA
33. CESKA SPORITELNA AS

34. CNP ASSURANCES SACA
35. COMMERZBANK AG
36. COOPERATIEVE RABOBANK UA
37. COTY INC
38. CREDIT AGRICOLE SA
39. CREDIT MUTUEL ARKEA
40. CROWN EURO HOLDINGS SA
41. DANSKE BANK A/S
42. DELL BANK INTERNATIONAL
43. DEUTSCHE LUFTHANSA AG
44. ENERGIZER GAMMA ACQ BV
45. OPTICS BIDCO SPA
46. FIDELITY NATL INFO SERV
47. FORVIA SE
48. GOLDMAN SACHS GROUP INC
49. HEIMSTADEN BOSTAD AB
50. HEIMSTADEN BOSTAD TRESRY
51. HOWOGE WOHNUNGS
52. IBERCAJA BANCO SA
53. ILIAD SA
54. IMA INDUSTRIA MACCHINE
55. ING GROEP NV
56. IQVIA INC
57. ISS GLOBAL A/S
58. JYSKE BANK A/S
59. KAIXO BONDCO TELECOM SA
60. KBC GROUP NV
61. LA DORIA SPA
62. LANDSBANKINN HF
63. LLOYDS BANKING GROUP PLC
64. LOGICOR FINANCING SARL
65. LOXAM SAS
66. MORGAN STANLEY
67. MUNDYS SPA
68. NATWEST GROUP PLC
69. NEXI SPA
70. NYKREDIT REALKREDIT AS
71. TMNL HOLD IV BV
72. PIRAEUS BANK SA
73. PRYSMIAN SPA
74. PVH CORP
75. Q-PARK HOLDING I BV
76. RAIFFEISEN BANK INTL
77. RAIFFEISENBANK AS
78. RCI BANQUE SA
79. RECKITT BENCKISER TSY
80. RUMĂNIEN
81. SANTANDER UK GROUP HLDGS
82. SELP FINANCE SARL
83. SOCIETE GENERALE
84. STANDARD CHARTERED PLC
85. SUEZ

86. SWEDBANK AB
87. TEAMSISTEM SPA
88. TECHEM VERWALTUNGSGESELL
89. TELECOM ITALIA SPA
90. UBS GROUP AG
91. UNICAJA BANCO SA
92. UNITED GROUP BV
93. VALEO SE
94. VOLVO CAR AB
95. VZ VENDOR FINANCING
96. WEBUILD SPA
97. WMG ACQUISITION CORP
98. ZEGONA FINANCE PLC
99. ZF EUROPE FINANCE BV
100. LORCA TELECOM BONDCO

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagement in grünen Anleihen	26,10%
Engagement in sozialen Anleihen	1,46%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Engagement in Umweltchampions	27,77%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%
Liste der Emittenten, mit denen die Anlageverwaltung zusammenarbeitet	100,00

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	tCO2e	1 304,83	77,88%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	tCO2e	151,61	77,88%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	tCO2e	9 623,54	78,14%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	tCO2e	1 456,44	77,88%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	tCO2e	11 079,98	78,14%
CO ₂ -Fußabdruck 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	51,42	77,93%
CO ₂ -Fußabdruck (Schätzung, EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	373,46	78,18%
THG-Emissionsintensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	40,16	88,34%
Geschätzte THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	489,08	88,60%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,22%	84,92%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	58,86%	79,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,07	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,79	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,18	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,04	80,61%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,30	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,68	80,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,55%	84,04%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,00	0,61%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen (EUR)	0,88	73,51%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	88,51%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,22%	82,24%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	15,24%	57,61%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	37,29%	83,75%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	85,05%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	366,26	2,72%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	2,72%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Nicht zutreffend. Der Fonds wurde am 27. März 2024 aufgelegt.

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:

- der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- der sozialen Integration,
- guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- 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:

- Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- 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
- 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 gesellschaftliche Aktivitäten mit einem sozialen Ziel zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- Erlöse für geeignete Sozialprojekte genutzt wurden,
- 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?

Die Anlageverwaltung 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 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Emissionsintensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) (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, mindestens 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden wie folgt verwendet:

- 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 siehe die Abschnitte „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie“ des Fonds in diesem Anhang).

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 die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie 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:

Auf 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 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 diesem Datenanbieter 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, welche 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 von der Anlageverwaltung 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.



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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: 27.03.2024 - 28.02.2025.

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
Government of Romania 6.625% 27-SEP-2029	Staatsanleihen	1,87%	Rumänien
Morgan Stanley 4.656% 02-MAR-2029	Finanzsektor	1,65%	USA
NatWest Group Plc 4.771% 16-FEB-2029	Finanzsektor	1,65%	Vereinigtes Königreich
ING Groep N.V. 4.5% 23-MAY-2029	Finanzsektor	1,64%	Niederlande
Standard Chartered PLC 0.8% 17-NOV-2029	Finanzsektor	1,59%	Vereinigtes Königreich
Societe Generale SA 4.75% 28-SEP-2029	Finanzsektor	1,55%	Frankreich
BPCE Societe anonyme 3.875% 11-JAN-2029	Finanzsektor	1,54%	Frankreich
Raiffeisenbank a.s. 1.0% 09-JUN-2028	Finanzsektor	1,53%	Tschechische Republik
Lloyds Banking Group PLC 4.5% 01/11/2029	Finanzsektor	1,50%	Vereinigtes Königreich
Abertis Infraestructuras, S.A. 4.125% 07-AUG-2029	Industrie	1,49%	Spanien
Credit Mutuel Arkea Societe cooperative a forme anonyme 3.5% 09-FEB-2029	Finanzsektor	1,49%	Frankreich
UBS Group AG 7.75% 03/01/2029	Finanzsektor	1,48%	Schweiz
KBC Group NV 4.25% 28-NOV-2029	Finanzsektor	1,47%	Belgien
Banque Federative du Credit Mutuel Societe anonyme 1.875% 18-JUN-2029	Finanzsektor	1,46%	Frankreich
Credit Agricole S.A. 0.5% 21-SEP-2029	Finanzsektor	1,46%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

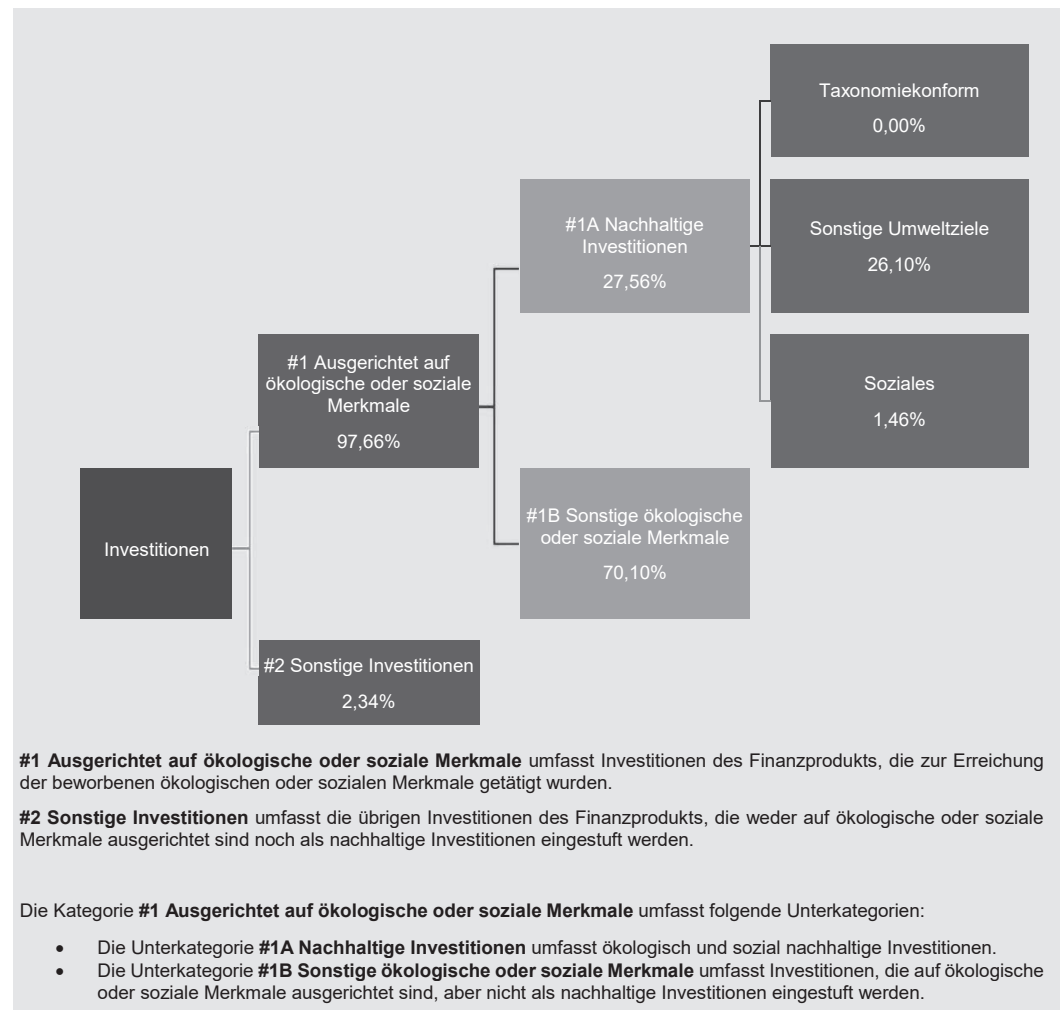
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 27,56 %.

Vermögensallokation
gibt den jeweiligen Anteil
der Investitionen in
bestimmte
Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,66 % des Fondsportfolios 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 (2,34 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 27,56 % 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	In % der Vermögenswerte
Finanzsektor	51,95%
Industrie	14,84%
Zyklische Konsumgüter	8,49%
Kommunikationsdienste	5,63%
Immobilien	4,39%
Basiskonsumgüter	3,19%
Informationstechnologie	2,84%
Staatsanleihen	2,72%
Gesundheitssektor	1,41%
Grundstoffe	1,31%
Versorgungsunternehmen	0,97%
Wichtigster Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Banken	41,59%
Kapitalmärkte	4,38%
Fahrzeugkomponenten	4,06%
Finanzdienstleistungen	3,78%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	3,28%
Passagierfluggesellschaften	2,90%
Staatsanleihen	2,72%
Verkehrsinfrastruktur	2,51%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,50%
Maschinen	2,13%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,03%
Automobilindustrie	2,02%
Unterhaltung	1,93%
Überlandtransport	1,74%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	1,45%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität **umfassen die Kriterien 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 Treibhausgasemissionen 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 Portfoliounternehmen aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft

- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln



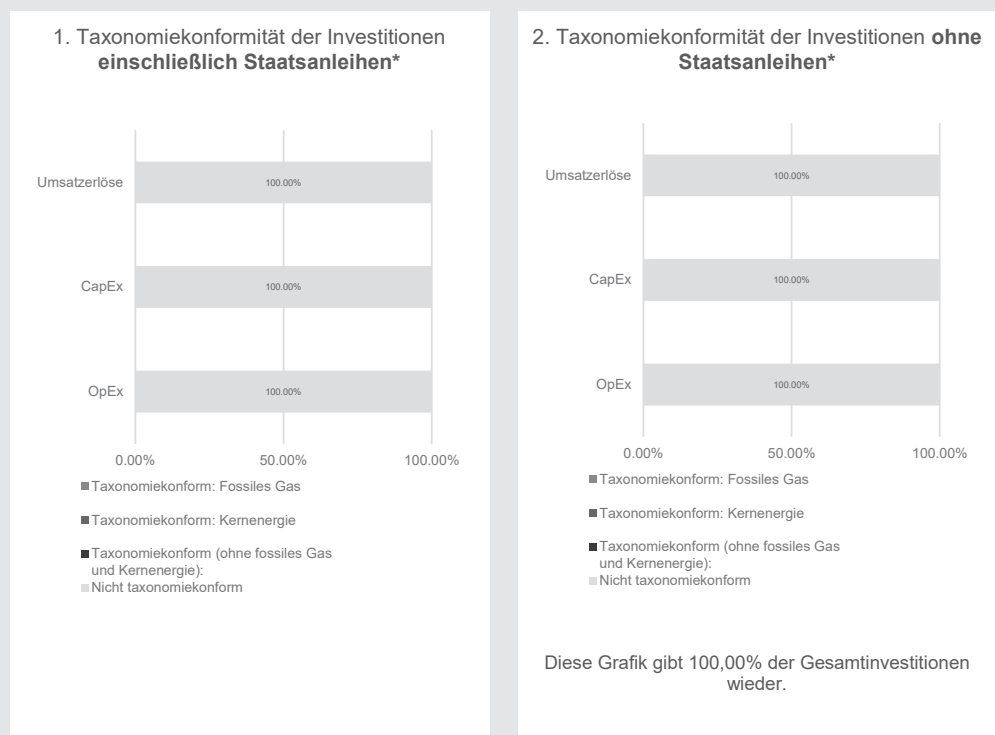
Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. 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 ist 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?

Nicht zutreffend.

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.

 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?

26,10 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1,46 %.



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 Sonstige“ lag bei 2,34 % 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. Die Anlageverwaltung 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 AnlagerverwalterInnen, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine unternehmenseigene Methode des ESG-Rating 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 AnlagerverwalterInnen 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 AnlagerverwalterInnen 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 die Anlageverwaltung überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung 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 die Anlageverwaltung 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.

Fiele ein vom Fonds gehaltenes Wertpapier unter mindestens einen der oben genannten Ausschlüsse, würde der Anlageverwalter/die Anlageverwalterin dieses Wertpapier schnellstmöglich, spätestens jedoch nach sechs Monaten, abstoßen.

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 (UNGC) und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen (PAI Nr. 10),
- ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen (PAI Nr. 14),
- mit Standorten/Betrieben in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, die in Kontroversen mit schweren nachteiligen Auswirkungen auf diese Gebiete involviert 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, mindestens 11 % des Portfolios im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung 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 die Anlageverwaltung, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüfen die AnlageverwalterInnen 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 AnlageverwalterInnen sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüfen die AnlageverwalterInnen 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 AnlageverwalterInnen 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 AnlageverwalterInnen 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 AnlageverwalterInnen 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 PortfoliomanagerInnen verdeutlichen.

- Der Dialog fand in einem eigens vereinbarten Einzelgespräch mit der Bank of Ireland Group im Dezember 2024 statt. Die ESG-Strategie des Konzerns ruht auf drei zentralen Säulen: Voranbringen des grünen Wandels, Stärkung des gesellschaftlichen Engagements und Pflege des positiven Miteinanders bei den Beschäftigten. Die AnlageverwalterInnen wollten sich umfassender über die Umweltstrategie des Konzerns und die Pläne für die anstehenden Offenlegungen informieren. In den Gesprächen wurde die Ausweitung seines Konzepts über Treibhausgasemissionen hinaus unterstrichen, das künftig auch Biodiversität und Wasserqualität umfassen soll. Der Emittent bezog sich auf seine Überwachung nationaler Indikatoren, unter anderem jener der Irish Environmental Protection Agency. Die AnlageverwalterInnen begrüßten die Maßnahmen zur Unterstützung von Landwirten durch gezielte Schulungen und Anreizmodelle und nahmen die Verpflichtung des Konzerns zur Kenntnis, seine Zahlen zur Konformität mit der EU-Taxonomie für 2024 im Februar 2025 zu veröffentlichen. Im Dialog wurden auch soziale Aspekte angesprochen wie die Anstrengungen des Konzerns zu Diversität und Inklusion. Der Emittent hat nach eigenen Angaben auf Ebene der Leitungs- und Kontrollgremien – im Einklang mit der irischen Gesetzgebung zur Lohngleichheit – Geschlechterparität erreicht. Gleichzeitig setzt er auf inklusive Maßnahmen wie Vaterschaftsurlaub und Unterstützung von Initiativen im Bereich Neurodiversität.
- Die AnlageverwalterInnen interagieren weiterhin mit den Emittenten, bei denen sie Beteiligungen besitzen. Die AnlageverwalterInnen arbeiten daran, mit den 5 % der Portfoliounternehmen aktiv in Kontakt zu treten, die im Kalenderjahr 2025 gegenüber den maßgeblichen verpflichtenden PAI-Kennzahlen als unterdurchschnittlich eingestuft wurden.



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]

