

Jahresbericht und geprüfter Abschluss

Franklin Templeton
Global Funds Plc
Ein Dachfonds mit getrennter
Haftung zwischen den Teilfonds
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023

Das Angebot der Anteile der Teilfonds Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund, Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund, Legg Mason ClearBridge Growth Fund, Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund, FTGF Western Asset Asian Income Fund, Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Legg Mason Emerging Markets Select Equity Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Japan Equity Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund, FTGF Western Asset Global Credit Fund, FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund, Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund, Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund, Legg Mason Martin Currie Greater China Fund, Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund, FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund, FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund, Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset UK£ Core Plus Bond Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund, Legg Mason Western Asset UK£ Long Duration Fund, Legg Mason US Equity Fund, Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund, Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund, Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund, Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund, FTGF Western Asset China Bond Fund, Franklin Responsible Series 2 Fund, Franklin Responsible Series 3 Fund, FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund, FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund, Legg Mason Western Asset US Dollar Liquidity Fund, FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund und Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund wurde der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht nicht gemäß § 310 KAGB (Kapitalanlagegesetzbuch) gemeldet.

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilhaber	16
Geänderter Bericht des Verwaltungsrats	17
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	40
Bericht der Verwahrstelle	42
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	43
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	44
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	53
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	68
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	72
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	77
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	81
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	84
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	86
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	90
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	95
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	99
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	107
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	115
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	119
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	127
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	130
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	136
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	140
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	142
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	146
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	148
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	150
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	153
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	157
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	159
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	161
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	163
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	165
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Value Fund	167
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	169
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	170
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	171
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	173
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	175
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	177
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	178
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	180
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	182
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	186
Anlagenportfolio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	188
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	189
Anlagenportfolio – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	190
Anlagenportfolio – Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	192
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	193
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	194
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	195
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	197
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	199
Anlagenportfolio – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	200
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	202
Bilanz – Franklin Templeton Global Funds Plc	204
Gesamtergebnisrechnung – Franklin Templeton Global Funds Plc	224
Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – Franklin Templeton Global Funds Plc	234
Anhang zum Abschluss – Franklin Templeton Global Funds Plc	264
Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	340
Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	346
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	360
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	360
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	360
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	361
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	361
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	361
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US High Yield Fund	362
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	362
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	363
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	363

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	364
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	364
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	365
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	365
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	365
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	365
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	366
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	366
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	367
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	367
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	368
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	368
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	368
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	369
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	369
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	370
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	370
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	370
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	371
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	371
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	371
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	372
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	372
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	373
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Value Fund	373
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	374
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	374
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	375
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	375
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	375
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	376
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	376
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	377
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	377
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	378
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	378
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	378
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	379
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	380
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	380
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	381
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	381
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	381
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	382
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	382
Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	383
Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)	384
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)	385
Anhang: Offenlegung verbundener Personen (ungeprüft)	386
Überarbeiteter Anhang: Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) (ungeprüft)	387

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 William Jackson (Großbritannien)
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Jaspal Saggar (Großbritannien)
 Jane Trust (Vereinigte Staaten)

Geschäftssitz

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

Secretary

Bradwell Limited
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 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
 Sec. 4, Zhong Xiao E. Rd., Taipeh
 Taiwan

Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited
 (bis 1. Juli 2022)
 Suites 1202-03
 12/F, York House
 15 Queen's Road Central
 Hongkong

Franklin Templeton Investments (Asia) Limited
 (mit Wirkung vom 1. Juli 2022)
 17/F, Chater House
 8 Connaught Road Central
 Hongkong

Templeton Asset Management Ltd.
 (mit Wirkung vom 1. Januar 2023,
 vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited)
 7 Temasek Boulevard, #38-03
 Suntec Tower One
 Singapur, 038987

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilhaber)

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

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

Schweizer Vertreter

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

Schweizer Zahlstelle

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

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

Irischer Rechtsberater

Arthur Cox LLP
 Ten Earlsfort Terrace, Dublin 2
 Irland

Verwahrstelle

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Verwaltungsstelle

BNY Mellon Fund Services (Ireland)
 Designated Activity Company
 One Dockland Central
 Guild Street, IFSC, Dublin 1
 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* (vormals Legg Mason Western Asset US Government Liquidity 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
FTGF Western Asset US Core Bond Fund* (vormals Legg Mason 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* (vormals Legg Mason 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* (vormals Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund*)	1. Oktober 2003	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* (vormals Legg Mason 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 Singapore 049145

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US High Yield Fund* (vormals Legg Mason 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^{a*}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 Singapore 049145
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund^{a*}b	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 Singapore 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* (vormals Legg Mason 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 Singapore 049145
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund^{a*}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* (vormals Legg Mason 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 Singapore 049145
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund* (vormals Legg Mason 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 Singapore 049145

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^{^*} (vormals Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [#])	13. Januar 2016	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 Mortgage-Backed Securities Fund^{^*} (vormals Legg Mason Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund [#])	13. Januar 2016	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 UK Investment Grade Credit Fund^{^*} (vormals Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [#])	17. November 2016	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 Singapore 049145
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^{^*} (vormals Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [#])	17. November 2016	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 Infrastructure Debt Fund^{^*^*} (vormals Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt 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 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 Singapore 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo - Brasilien

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund* (vormals Legg Mason 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^{^*} (vormals Legg Mason 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^{^*} (vormals Legg Mason 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* (vormals Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [#])	25. Juni 2010	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^{^*b}	10. Mai 2012 (Handel eingestellt am 25. Februar 2021)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund* (vormals Legg Mason 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^{^*} (vormals Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [#])	30. Juni 2014	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^{^*} (vormals Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [#])	6. April 2017	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund^{^*b}	30. Oktober 2017 (Handel eingestellt am 29. Januar 2020)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^{^*} (vormals Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [#])	16. August 2018	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^{^*} (vormals Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [#])	1. Dezember 2022	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^{^**} (vormals Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [#])	31. Dezember 2015	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 – EM Macro Bond Fund**^A (vormals Legg Mason Brandywine Global - EM Macro Bond Fund [®])		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF ClearBridge Value Fund** (vormals Legg Mason 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** (vormals Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund [®])	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund** (vormals Legg Mason 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** (vormals Legg Mason 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** (vormals Legg Mason 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^*** (vormals Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [®])	30. September 2015	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Growth Fund**^A (vormals Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [®])	29. Juni 2018	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund**^A (vormals Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [®])	9. Dezember 2016	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (vormals ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund**^Ab	31. März 2017 (Handel eingestellt am 17. November 2022)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (vormals ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund** (vormals Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund [®])	30. April 2021	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (vormals ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund** (vormals Legg Mason 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** (vormals Legg Mason 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^** (vormals 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^***[‡]	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** (vormals Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [†])	25. Februar 2004	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^***[‡]	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^***[‡]	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^***[‡]	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**^[†] (vormals Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [†])	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 t Ltd. (mit Wirkung vom 1. Januar 2023, vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund**^[†]	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 t Ltd. (mit Wirkung vom 1. Januar 2023, vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Franklin Responsible Series 3 Fund* [†]		Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

^μ Money Market Fund.

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

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

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

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

[♯] Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

Weitere Informationen

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

Für professionelle Anleger in Europa (außer VK und Schweiz)

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

www.franklinresources.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

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

www.franklintempletonoffshore.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

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

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

wir freuen uns, Ihnen den Jahresbericht für Franklin Templeton Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den Zwölfmonatszeitraum zum 28. Februar 2023 vorlegen zu können. In diesem Bericht heben wir die Haupttreiber der Entwicklung der Anleihe- und Aktienmärkte während des Berichtszeitraums hervor.

Bericht über die Weltwirtschaft

Die globale Wirtschaft wurde im Berichtszeitraum durch eine Reihe von Faktoren belastet, darunter die anhaltend hohe Inflation, die aggressive geldpolitische Straffung, Lieferkettenprobleme, die Folgen von Covid-19 und die Auswirkungen des Kriegs in der Ukraine. In seinem im Januar 2023 veröffentlichten *World Economic Outlook Update* hat der Internationale Währungsfonds („IWF“) seine Wachstumsprognosen gegenüber seinem Update vom Oktober 2022 leicht angehoben. Der IWF sagte: „Die Risiken überwiegen weiterhin, aber sie haben sich seit dem *World Economic Outlook* 2022 abgeschwächt. Positiv schlägt zu Buche, dass eine stärkere Dynamik durch die aufgestaute Nachfrage in zahlreichen Volkswirtschaften bzw. ein schnellerer Rückgang der Inflation plausibel sind. Andererseits könnte die Gesundheitsproblematik in China die Erholung bremsen, Russlands Krieg in der Ukraine könnte eskalieren und strengere globale Finanzierungsbedingungen könnten die Schuldenproblematik verschärfen. Als Reaktion auf negative Inflationsmeldungen könnten die Finanzmärkte auch plötzlich ihre Preise korrigieren, während eine weitere geopolitische Fragmentierung die wirtschaftliche Entwicklung beeinträchtigen könnte.“ Insgesamt geht der IWF davon aus, dass sich das globale Wachstum im Jahr 2022 von 3,4 % auf 2,9 % im Jahr 2023 abschwächen wird. Aus regionaler Perspektive prognostiziert der IWF, dass das BIP im Jahr 2023 in der Eurozone bei 0,7 % (gegenüber +3,5 % im Jahr 2022), -0,6 % im Vereinigten Königreich (gegenüber 4,1 % im Jahr 2022) und 1,8 % in Japan (gegenüber 1,4 % im Jahr 2022) liegen wird.

Marktüberblick – Rentenmärkteⁱ

Der globale Rentenmarkt erzielte im Berichtszeitraum insgesamt schwache Ergebnisse. In den USA zogen die Renditen der Staatsanleihen stark an, da die Inflation ein Mehrjahreshoch erreichte. Vor diesem Hintergrund hob die US-Notenbank („Fed“) den Leitzins im Berichtszeitraum achtmal an. Mit der Anhebung im Februar 2023 erhöhte sich der Leitzins auf seinen höchsten Stand seit 2007. Die Renditen der zehnjährigen US-Staatsanleihen begannen den Berichtszeitraum mit 1,83 % und lagen an dessen Ende bei 3,92 %. Die Zinsen stiegen auch in Industrieländern außerhalb der USA. US-Staatsanleihen und Investment-Gradeⁱⁱ-Unternehmensanleihenⁱⁱⁱ verzeichneten negative Renditen. Niedriger bewertete US-Unternehmensanleihen und auch auf US-Dollar lautende Staatsanleihen aus Schwellenländern negative Renditen.

Marktüberblick – Globale Aktien^{iv}

Globale Aktien mussten mit erhöhter Volatilität zurechtkommen und verbuchten im Berichtszeitraum eine schwache Performance. Die Anlegerstimmung wurde durch die hohe Inflation, die geldpolitische Straffung, Ängste vor einer globalen Rezession und geopolitischen Problemen belastet. In dem Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 rentierte der S&P 500 Index mit -7,69 %. Außerhalb der USA verzeichneten internationale Industrieländeraktien, gemessen am MSCI EAFE Index (net), eine Rendite von -3,14 %, während Schwellenländeraktien, gemessen am MSCI Emerging Markets Index (net), mit -15,28 % rentierten.

i Rentenwerte – Anleihen.

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

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

März 2023

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

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 28. Februar 2023, sofern nichts anderes angegeben ist.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats

Nach der Genehmigung des Berichts des Verwaltungsrats, jedoch vor der Veröffentlichung des Jahresberichts für die Anteilhaber, hat der Verwaltungsrat der Gesellschaft (der „Verwaltungsrat“) zusätzliche Informationen in den Abschnitt mit der Überschrift „Geänderter Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)“ gemäß Section 366 (1)(b) und (4)(a) des Companies Act 2014 aufgenommen. Der Verwaltungsrat legt seinen geänderten Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 vor.

Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

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

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

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

Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

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

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

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

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

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

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

Überblick über die Geschäftstätigkeit und zukünftige Entwicklungen

Der Brief an die Anteilhaber auf Seite 16 beinhaltet eine Darstellung der Faktoren, die zur Performance der Fonds im Berichtsjahr beigetragen haben. Der Verwaltungsrat geht nicht davon aus, dass sich die Anlageziele der bestehenden Fonds ändern werden, sofern in Erläuterung 16 – Ereignisse nach dem Stichtag dieses Abschlusses nicht anders angegeben.

Zum 28. Februar 2023 hat das Unternehmen 48 aktive Fonds (2022: 54 Fonds). Einzelheiten zu ihren Nettoinventarwerten zum 28. Februar 2023 sind der Bilanz auf den Seiten 206 bis 225 zu entnehmen.

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

Mit Wirkung vom 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 stellte der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 17. November 2022 stellte der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 nahm der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 stellte der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 nahm der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel auf.

Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 stellte der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel ein.

Ziele und Grundsätze des Risikomanagements

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

Ergebnisse des Geschäftsjahres und Finanzlage zum 28. Februar 2023

Die Bilanz zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 und die Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 sind auf den Seiten 206 bis 225 bzw. 226 bis 234 dargelegt.

Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile

Die Ausschüttungen an die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile für die am 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 endenden Geschäftsjahre sind in der Gesamtergebnisrechnung dargelegt.

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.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Mitglieder des Verwaltungsrats

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

Joseph Carrier (Vereinigte Staaten)
 Fionnuala Doris (Irland) (unabhängig)
 William Jackson (Großbritannien)
 Joseph Keane (Irland) (unabhängig)
 Joseph LaRocque (Vereinigte Staaten)
 Jaspal Sagger (Großbritannien)
 Jane Trust (Vereinigte Staaten)

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 2023 und 28. Februar 2022. Kein Verwaltungsratsmitglied hatte zu einem jeglichen Zeitpunkt im Laufe des Geschäftsjahres eine erhebliche Beteiligung an einem wesentlichen Vertrag, der während des Jahres oder zum Geschäftsjahresende im Hinblick auf das Geschäft der Gesellschaft existierte.

Erklärung zur Corporate Governance

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

Compliance-Erklärung des Verwaltungsrats

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

Relevante Prüfungsinformationen

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

Transaktionen mit verbundenen Personen

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

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

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, mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], wurden von der Securities and Futures Commission in Hongkong zugelassen. Daher sind die oben genannten Fonds nicht zum Verkauf an die Öffentlichkeit zugelassen. Die Zulassung durch die Securities and Futures Commission of Hong Kong stellt keine Empfehlung für eine Anlage in die Fonds dar.

Das Hauptanlageziel und die Anlagepolitik aller aktiven Fonds zum Ende des Geschäftsjahres sind unten und auf den folgenden Seiten dargelegt. 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-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 das Unternehmen in seine regelmäßigen Berichte eine Beschreibung aufnehmen muss, inwieweit jeder nach Artikel 8 SFDR klassifizierte Fonds (ein „Artikel 8-Fonds“) seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wird. Gemäß SFDR sind zudem die Europäische Bankenaufsicht, die Europäische Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (zusammen die „europäischen Aufsichtsbehörden“) befugt, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, die Inhalt und Format der Informationen für die regelmäßigen Berichte vorgeben. Die folgenden Angaben wurden unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS gemacht. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlageziel – Aufrechterhaltung des Kapitals des Fonds und Erzielung einer Rendite, die sich an den Geldmarktzinsen orientiert.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 99,5 % seines Nettoinventarwerts in: (i) zulässige Geldmarktinstrumente, die gesondert begeben oder garantiert werden von der Europäischen Union, den nationalen, regionalen und lokalen Verwaltungen der Mitgliedstaaten oder deren Zentralbanken, der Europäischen Zentralbank, der Europäischen Investitionsbank, dem European Investment Fund, dem Europäischen Stabilitätsmechanismus, der Europäische Finanzstabilisierungsfazilität, einer Zentralbehörde oder Zentralbank eines Drittlandes (einschließlich der USA), dem Internationalen Währungsfonds, der Internationalen Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, der Entwicklungsbank des Europarates, der Europäischen Bank für Wiederaufbau und Entwicklung, der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich oder anderen relevanten

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund – (Fortsetzung)

internationalen Finanzinstitutionen oder -organisationen, denen ein oder mehrere Mitgliedstaaten angehören, wobei zu den Emittenten unter anderem die Federal National Mortgage Association (Fannie Mae), die Federal Home Loan Mortgage Corporation (Freddie Mac), die Government National Mortgage Association (Ginnie Mae), die Student Loan Marketing Association (Sallie Mae) und die Federal Home Loan Bank („staatliche Geldmarktinstrumente“) gehören können, (ii) zulässige umgekehrte Pensionsgeschäfte, die mit staatlichen Geldmarktinstrumenten besichert sind, und (iii) Bareinlagen in US-Dollar.

Abweichend davon ist der Fonds von der Zentralbank ermächtigt, bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts in staatliche Geldmarktinstrumente zu investieren, sofern (i) er staatliche Geldmarktinstrumente aus mindestens sechs verschiedenen Emissionen je Emittent hält und (ii) die Anlage in staatliche Geldmarktinstrumente derselben Emission auf 30 % seines Nettoinventarwerts beschränkt. Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in staatliche Geldmarktinstrumente, die auf US-Dollar lauten und von US-Emittenten begeben werden. Der Fonds beabsichtigt nicht, Finanzderivate zu irgendeinem Zweck einzusetzen.

Der Fonds ist ein Constant Net Asset Value („CNAV“)-Geldmarktfonds mit kurzer Laufzeit gemäß den Zentralbankvorschriften.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 75 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die (i) an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, (ii) auf US-Dollar lauten und (iii) zum Zeitpunkt des Kaufs mindestens mit BBB von S&P oder einem gleichwertigen Rating einer anderen NRSRO bewertet sind oder, falls kein Rating vorliegt, vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter des Fonds als von vergleichbarer Qualität eingestuft werden. Der Fonds kann in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von der US-Regierung, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations.

Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Anlagen von Emittenten oder Unternehmen investiert, die ihren eingetragenen Sitz in den Vereinigten Staaten haben oder einen wesentlichen Teil ihrer Geschäftstätigkeit in den Vereinigten Staaten ausüben.

Durch den Einsatz von Derivaten kann der Nettoinventarwert des Fonds bis zu 100 % gehebelt sein (berechnet nach dem Commitment-Ansatz). Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapieren von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg US Aggregate Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“).

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Kapitalzuwachs und Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden und über ein Investment-Grade-Rating verfügen oder, falls kein Rating vorhanden ist, eine vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter als gleichwertig erachtete Kreditqualität aufweisen und von US-Emittenten begeben werden. Zu den Wertpapieren, in die der Fonds investieren darf, gehören Schuldtitel, die von der US-Regierung, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, Schuldtitel, die von anderen nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben werden, Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensschuldtitel, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen; bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften sowie hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind.

Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Vorbehaltlich der in der Anlagepolitik festgelegten Beschränkungen darf der Fonds zudem insgesamt bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in nicht öffentlich gehandelte Rule-144A-Wertpapiere, Nullkuponwertpapiere, Geldmarktinstrumente und Schuldtitel von Nicht-US-Emittenten investieren. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen.

Die Verteilung und Neuverteilung der Vermögenswerte des Fonds erfolgen durch den Anlageverwalter und den Unteranlageverwalter auf der Grundlage ihrer Analyse der wirtschaftlichen und Marktbedingungen sowie der relativen Risiken und Chancen bestimmter Arten von festverzinslichen Wertpapieren. Die durchschnittliche Portfolioduration variiert je nach der Prognose des Unteranlageverwalters für die Zinssätze.

Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts erzielen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

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

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg US Aggregate Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“).

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Kapitalzuwachs und Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in auf Euro lautende Schuldtitel, die an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Fonds investiert in die folgenden Arten von Wertpapieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen von Industrie- und Schwellenländern, ihren Gebietskörperschaften und Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensanleihen von Emittenten mit Sitz in Industrie- und Schwellenländern oder deren Wertpapiere an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds investiert nicht in Beteiligungspapiere, einschließlich Optionsscheine, mit Ausnahme von (1) Vorzugsaktien bis maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds und (2) Beteiligungspapieren, die durch Umwandlung von wandelbaren Schuldtiteln oder durch Kapitalmaßnahmen von Emittenten (z. B. die Ausgabe von Aktien als Ersatz für zuvor ausgegebene Schuldtitel) erworben werden. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) erzielen. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können.

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] (Handel eingestellt am 16. Februar 2023)

Anlageziel – Erzielung hoher laufender Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldtitel und Instrumente, die (i) auf US-Dollar und Währungen verschiedener anderer Industrieländer lauten und (ii) an geregelten Märkten gemäß Anhang III des Prospekts notiert sind oder gehandelt werden. Zu diesen hochverzinslichen Schuldtiteln und Instrumenten gehören: (i) Unternehmensschuldtitel, einschließlich (a) frei übertragbarer Schuldscheine, (b) Schuldverschreibungen, (c) Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), (d) wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, (e) bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), (f) Credit-Linked Notes, (g) Commercial Paper, (h) Einlagenzertifikate und (i) Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, (ii) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, (iii) hypotheckenbesicherte Wertpapiere, (iv) forderungsbesicherte Wertpapiere und (v) unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können, sofern der Fonds mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in nicht wandelbare Schuldtitel investiert. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen NRSRO mit einem gleichwertigen Rating bewertet wurden. Diese Ratings besagen, dass es sich bei den Schuldtiteln um hochspekulative Wertpapiere handelt und sie möglicherweise in Bezug auf Kapital und Zinsen in Zahlungsverzug sind oder geraten könnten.

Das übrige Vermögen des Fonds kann in die folgenden Arten von Wertpapieren investiert werden, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel mit Investment-Grade-Rating oder Wertpapiere ohne Rating, die vom Anlageverwalter und Unteranlageverwalter als gleichwertig eingestuft werden, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations sowie Liquidität und Geldmarktinstrumente. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile von offenen Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldtitel, die auf US-Dollar, den japanischen Yen, Pfund Sterling, Euro und verschiedene andere Währungen lauten und an einem geregelten Markt in Industrie- oder Schwellenländern gehandelt werden oder notiert sind, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Fonds kann in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen von Industrie- und Schwellenländern, ihren Gebietskörperschaften und Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensanleihen von Emittenten mit Sitz in Industrie- und Schwellenländern oder deren Wertpapiere an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), Schwellenländer-Schuldtitel (einschließlich Brady Bonds, Eurobonds, nationale und internationale Anleihen, die nach den Gesetzen eines Entwicklungslandes begeben werden), wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)

des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können. Diese Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die Absatz 2.1 in Anhang II.A. zum Verkaufsprospekt unterliegen, insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen.

Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des 50 % Bloomberg Global Aggregate Index, 25 % JP Morgan Global Emerging Markets Diversified Index und 25 % Bloomberg US High Yield Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlageziel – Erzielung hoher laufender Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in die folgenden Arten hochverzinslicher Schuldtitel von US-Emittenten, die auf US-Dollar lauten und an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden: Unternehmensschuldtitel, auch frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, sowie hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, sofern mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds in nicht wandelbare Schuldtitel investiert werden. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen NRSRO mit einem gleichwertigen Rating bewertet wurden. Diese Ratings besagen, dass es sich bei den Schuldtiteln um hochspekulative Wertpapiere handelt und sie möglicherweise in Bezug auf Kapital und Zinsen in Zahlungsverzug sind oder geraten könnten.

Das übrige Vermögen des Fonds kann gehalten werden in Schuldtiteln, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von S&P mit einem Rating über BB+ oder von einer anderen NRSRO mit einem gleichwertigen Rating bewertet werden, oder in Wertpapieren ohne Rating, die nach Ansicht des Anlageverwalters und des Unteranlageverwalters von gleichwertiger Qualität sind, Vorzugsaktien und anderen Beteiligungspapieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, sofern diese Anlagen mit dem Anlageziel des Fonds, hohe laufende Erträge zu erzielen, vereinbar sind, sowie in Liquidität oder kurzfristigen Geldmarktinstrumenten mit Restlaufzeiten von 13 Monaten oder weniger. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Unternehmensschuldtitel von Emittenten außerhalb der USA investieren, die ihren Sitz in Industrie- und Schwellenländern haben, sofern diese Schuldtitel auf US-Dollar lauten und diese Emittenten dort ansässig sind oder ihre Hauptgeschäftstätigkeit in OECD-Mitgliedsländern ausüben. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Mindestens 95 % des Nettoinventarwerts des Fonds werden auf US-Dollar lauten. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten relevanter Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg US Corporate High Yield, 2 % Issuer Cap Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten. Zudem strebt der Fonds eine absolute jährliche Reduzierung der CO₂-Intensität an.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“).

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] (Handel eingestellt am 10. Oktober 2022)

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in (i) Schuldtitel von Emittenten mit Sitz in Schwellenländern (im Folgenden „Schwellenländer-Schuldtitel“), die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, und (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei solche Anlagen zum Zweck des Aufbaus eines Engagements in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten oder anderweitig zur Verfolgung des Anlageziels und der Anlagepolitik des Fonds erfolgen. Der Fonds kann in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden: Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in Industrie- und Schwellenländern, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), Unternehmensschuldtitel von Emittenten mit Sitz in Industrie- und Schwellenländern, deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder dort gehandelt werden, darunter frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen sowie bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen,

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] (Handel eingestellt am 10. Oktober 2022) – (Fortsetzung)

Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverschreibungen), verbriefte Beteiligungen an Krediten, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, forderungsbesicherte Wertpapiere, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Verordnung 68(1)(e) der UCITS Regulations, sofern mindestens zwei Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds in nicht wandelbare Schuldtitel investiert sind.

Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können. Diese Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die Absatz 2.1 in Anhang II.A. zum Verkaufsprospekt unterliegen, insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen. Die Anlagen des Fonds können auf andere Währungen als die Basiswährung lauten. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schwellenländer-Unternehmensanleihen, die auf eine beliebige Währung lauten und an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich (i) frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- und variabel verzinsliche Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, (ii) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverschreibungen), (iii) verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, (iv) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, und (v) forderungsbesicherte Wertpapiere.

Der Fonds kann bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden (die folgenden Wertpapiere können auf jede beliebige Währung lauten) und bei denen es sich nicht um Schwellenländer-Unternehmensanleihen handelt: (i) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in einem beliebigen Land, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), (ii) Unternehmensschuldtitel von Emittenten mit Sitz in anderen Ländern als Schwellenländern, deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- und variabel verzinslicher Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbarer und nicht wandelbarer Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, (iii) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverschreibungen), (iv) verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, (v) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, (vi) forderungsbesicherte Wertpapiere, (vii) Vorzugsaktien und (viii) andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations.

Der Fonds kann in Stammaktien, Vorzugspapiere, wandelbare Wertpapiere, Optionsscheine, Bezugsrechte und gleichwertige Titel investieren. Der Fonds investiert nicht mehr als 25 % seines Nettoinventarwerts in wandelbare Schuldtitel, die in unabhängigen Emissionen begeben werden, und nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Vorzugsaktien, die in unabhängigen Emissionen begeben wurden. Anlagen in Stammaktien, Vorzugspapieren, Optionsscheinen, Bezugsrechten und gleichwertigen Titeln (auch über unabhängige Emissionen und anderweitig) dürfen insgesamt 30 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht überschreiten. Vorstehendes wird wie folgt eingeschränkt: Der Fonds darf jeweils nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in die folgenden Arten von Wertpapieren investieren: (i) hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich besicherter Schuldverschreibungen), (ii) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, und (iii) forderungsbesicherte Wertpapiere. Die hypothekenbesicherten Wertpapiere, forderungsbesicherten Wertpapiere, strukturierten Schuldverschreibungen und Credit-Linked Notes, in die der Fonds investieren darf, können eingebettete Derivate und/oder Leverage enthalten. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Durch den Einsatz von Derivaten kann der Nettoinventarwert des Fonds bis zu 100 % gehebelt sein (berechnet nach dem Commitment-Ansatz). Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlageziel – Erzielung einer Gesamrendite. Die Erzielung hoher laufender Erträge ist ein sekundäres Ziel.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldtitel, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Höhere Renditen sind im Allgemeinen bei Wertpapieren mit einem Rating von BB+ oder niedriger von S&P oder einem gleichwertigen Rating einer anderen NRSRO oder bei Wertpapieren ohne Rating gleicher Qualität zu erwarten. Schuldtitel mit einem Rating unterhalb von „Investment Grade“ werden von diesen Agenturen im Hinblick auf die Fähigkeit des Emittenten, Zinsen und Kapital zurückzuzahlen, als deutlich spekulativ eingestuft und können mit einem erheblichen Risiko der Anfälligkeit für ungünstige Bedingungen verbunden sein. Der Fonds kann in Schuldtiteln investieren, die von S&P mit D oder von einer anderen NRSRO mit einem gleichwertigen Rating bewertet wurden. Diese Ratings besagen, dass es sich bei den Schuldtiteln um hochspekulative Wertpapiere handelt und sie möglicherweise in Bezug auf Kapital und Zinsen in Zahlungsverzug sind oder geraten könnten. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in CoCo-Anleihen investiert werden. Der Fonds wird voraussichtlich nicht mehr als 45 % seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Wertpapiere investieren, die in Schwellenländern, europäischen Schwellenländern und/oder Schwellenländern im Asien-Pazifik-Raum begeben werden. Der Fonds wird voraussichtlich in mindestens zehn verschiedenen Ländern investieren. Der Fonds ist jedoch ein globaler Fonds und nicht auf Investitionen in einem bestimmten Land oder einer bestimmten Region beschränkt. Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können. Diese Beteiligungen dürfen zusammen mit anderen Anlagen, die Absatz 2.1 in Anhang II.A. zum Verkaufsprospekt unterliegen, insgesamt 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Durch den Einsatz von Derivaten kann der Nettoinventarwert des Fonds bis zu 100 % gehebelt sein (berechnet nach dem Commitment-Ansatz). Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich Ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg Barclays Global High Yield Index (Hedged) USD (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“). Dies bedeutet, dass der Fonds eine höhere Allokation in UN-SDG-Emittenten aufweist als die Benchmark.

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] (Handel eingestellt am 5. Dezember 2022)

Anlageziel – Erzielung einer Gesamtrendite. Die Erzielung laufender Erträge ist ein sekundäres Ziel.

Anlagepolitik – Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er jederzeit mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in inflationsgeschützte Wertpapiere oder andere Wertpapiere investiert, von denen der Anlageverwalter und der Untereinlageverwalter glauben, dass sie Schutz vor Inflation bieten und die von nationalen Regierungen von Ländern, die Mitglied der OECD sind, ihren Gebietskörperschaften und Behörden, supranationalen Organisationen und Unternehmen begeben werden, wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Fonds kann außerdem bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in alle anderen Arten von Schuldtiteln investieren, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und gegebenenfalls an die Inflation gekoppelt sind, einschließlich Schuldtiteln, die von nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben und garantiert werden (einschließlich STRIP-Wertpapiere), Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen, Step-up-Wertpapiere und PIK-Wertpapiere), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken und Bankholdinggesellschaften, hypothecken- und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften), strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, Geldmarktinstrumente, Anteile anderer offener Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations und (vorbehaltlich einer Obergrenze von 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds) Vorzugsaktien und andere Aktien und aktienähnliche Wertpapiere. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds investiert nicht in Wertpapiere mit einem Rating unterhalb von „Investment Grade“. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Wertpapiere investiert werden, die an einem geregelten Markt in einem Schwellenland, einem europäischen Schwellenland oder einem Schwellenland im Asien-Pazifik-Raum notiert sind oder gehandelt werden. Der Fonds wird voraussichtlich beständig eine durchschnittliche Kreditqualität zwischen A und AAA (S&P)/A2 und Aaa (Moody's) aufweisen. Die durchschnittliche Portfolioduration des Fonds wird voraussichtlich zwischen einem und fünfzehn Jahren liegen. Der Fonds kann jedoch in Einzeltitel beliebiger Duration investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) erzielen. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel asiatischer Emittenten und in Derivate auf asiatische Zinssätze und Währungen, wobei diese Schuldtitel und Derivate an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Fonds investiert hauptsächlich in (i) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen in asiatischen Ländern, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, (ii) Unternehmensschuldtitel asiatischer Unternehmen wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen und Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, (iii) verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, (iv) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, (v) hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, (vi) Derivate auf asiatische Zinssätze und asiatische Anleihen, die mit hoch bewerteten asiatischen oder globalen Kreditinstituten abgeschlossen werden, (vii) asiatische Währungen und Derivate auf diese Währungen. Für die Zwecke dieses Fonds ist ein asiatisches Unternehmen ein Unternehmen, das seinen eingetragenen Sitz in einem asiatischen Land hat oder den überwiegenden Teil seiner wirtschaftlichen Aktivitäten in Asien ausübt.

Der Fonds darf bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer offener Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Bis zu 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Wandelanleihen investiert werden und bis zu 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds in Vorzugsaktien, andere Beteiligungspapiere und/oder Optionsscheine. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Optionsscheine investiert werden.

Durch den Einsatz von Derivaten kann der Nettoinventarwert des Fonds bis zu 100 % gehebelt sein (berechnet nach dem Commitment-Ansatz). Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlageziel – Erzielung einer Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldtitel, die (i) von S&P mit A- oder höher oder von einer anderen NRSRO mit einem gleichwertigen Rating bewertet sind oder – wenn kein Rating vorliegt – als von vergleichbarer Qualität gelten, (ii) (a) von Unternehmensemittenten begeben werden, die ihren Sitz in einer anderen Rechtsordnung als einem Schwellenland haben und zum Zeitpunkt des Kaufs und nach Auffassung der Untereinlageverwalter „Blue-Chip“-Unternehmen sind, was bedeutet, dass sie ein langfristiges Kreditrating von A- oder höher von S&P oder ein gleichwertiges Rating einer anderen NRSRO haben oder – wenn kein Rating vorliegt – als von vergleichbarer Qualität gelten, und/oder (b) von supranationalen Organisationen begeben werden, die ein langfristiges Kreditrating von A- oder höher von S&P haben oder ein gleichwertiges Rating einer anderen NRSRO oder – wenn kein Rating vorliegt – als von vergleichbarer Qualität gelten, und (iii) an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden.

Der Fonds investiert nur in solche Unternehmensschuldtitel, die nach Ansicht des jeweiligen Anlageverwalters und Untereinlageverwalters mindestens als vorrangige unbesicherte Unternehmensschuldtitel des betreffenden Emittenten eingestuft sind. Darüber hinaus kann der Fonds in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen (einschließlich STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere), ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, sowie in Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Vorschriften der irischen Zentralbank) und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren. Die aus Derivaten resultierende Hebelwirkung des Fonds wird voraussichtlich 50 % (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) seines Gesamt-Nettoinventarwerts nicht übersteigen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und des einzelnen Emittenten und seiner Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten relevanter Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des ICE BofA Global Corporate 1–5 year AAA-A Global Large Cap Corporate 30 % Financial Constrained Index (die „Benchmark“) liegt. Der Anlageverwalter definiert den CO₂-Fußabdruck als den gewichteten Durchschnitt der CO₂-Emissionsintensität der im Portfolio gehaltenen Wertpapiere. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Das Fondsportfolio wird beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt. Der Fonds darf höchstens 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten investieren, die zum Zeitpunkt des Kaufs MSCI ESG-Ratings von BB oder darunter aufweisen. Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter ESG-Ratings bei mindestens 90 % der Wertpapiere an, in die der Fonds investiert. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds. Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, mindestens 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen.

Der Fonds schließt Anlagen in Wertpapieren der folgenden Emittenten aus:

- Emittenten, die keine guten Governance-Praktiken anwenden, wie vom Anlageverwalter bestimmt,
- Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit Tabakproduktion und/oder -vertrieb erzielen,
- Emittenten, die mehr als 10 % ihres Umsatzes erzielen aus:
 - zivilen Schusswaffen (Herstellung/Lieferung),
 - jeglicher Beteiligung an konventionellen Waffen,
 - der Förderung von Kraftwerkskohle (Produktion/Vertrieb),
- Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Produktion von Atomwaffen erzielen,
- Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden,
- Emittenten, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden, und
- Staaten und/oder staatliche Emittenten, die gemäß dem Freedom House Index unzureichend abschneiden.

Der Anlageverwalter wird sich durch Gespräche mit dem Management mit Emittenten über ESG-Praktiken auseinandersetzen. Der Prozess der aktiven Mitwirkung (Engagement) des Anlageverwalters soll sich an den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen orientieren.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamterträge durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts an den globalen Rentenmärkten. Der Fonds investiert hauptsächlich in Schuldtitel (entweder direkt oder indirekt in andere Organismen für gemeinsame Anlagen, die vorwiegend in solche Wertpapiere investieren, vorbehaltlich der hier festgelegten Beschränkungen), die auf US-Dollar, Euro, den japanischen Yen, Pfund Sterling und verschiedene andere Währungen lauten und an geregelten Märkten in Industrie- und Schwellenländern notiert sind oder dort gehandelt werden, wobei der Schwerpunkt auf nichtstaatlichen Schuldtiteln liegt, insbesondere auf Unternehmensschuldtiteln und hypotheckenbesicherten Wertpapieren. Der Fonds darf in nicht auf US-Dollar lautende Wertpapiere, Währungen und Derivate investieren, sofern das Gesamtengagement in anderen Währungen als dem US-Dollar (nach Absicherung) nicht mehr als 50 % des Nettoinventarwerts des Fonds beträgt.

Der Fonds investiert in Wertpapiere, die von nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich STRIPS und an den Inflationsindex gebundene Wertpapiere), Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Brady-Anleihen, Anleihen mit anpassbarem Zinssatz, Anleihen mit variablem Zinssatz, Anleihen mit geplanter Tilgung, Anleihen mit gezielter Tilgung, Principal-Only-Anleihen, Eurobonds, Eurodollar-Anleihen und Yankee-Dollar-Instrumente, PIK-Anleihen, Nullkuponanleihen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, und umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften). Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds darf unverbriefte Beteiligungen an oder Abtretungen von zinsvariablen Hypotheken oder anderen gewerblichen Krediten erwerben, die liquide sind und wenigstens alle 397 Tage eine Anpassung des Zinssatzes vorsehen und die durch Immobilien oder andere Vermögenswerte besichert sein können. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts erzielen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg Global Aggregate Index (Hedged) USD (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“).

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel und Schuldtitel von supranationalen Organisationen, die (i) auf US-Dollar, den japanischen Yen, Euro, Pfund Sterling und verschiedene andere Währungen lauten und (ii) an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Zu den Arten von Unternehmensschuldtiteln, in die der Fonds investieren darf, gehören frei übertragbare Schuldscheine, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften. Darüber hinaus kann der Fonds in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen (einschließlich STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere), ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, sowie in Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich Collateralised Mortgage Obligations), forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Vorschriften der irischen Zentralbank) und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations.

Der Fonds wird keine Beteiligungspapiere oder wirtschaftliches Eigentum an Beteiligungspapieren erwerben, mit Ausnahme von Vorzugsaktien oder Optionsscheinen, wobei nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Vorzugsaktien und/oder Optionsscheinen investiert werden dürfen, und Beteiligungspapieren, die durch Umwandlung von wandelbaren Schuldtiteln oder durch Kapitalmaßnahmen von Emittenten erworben werden. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann Wertpapiere kaufen, die zum Zeitpunkt des Kaufs ein Rating unter „Investment Grade“ haben oder, falls sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter und den Unteranlageverwaltern als von vergleichbarer Qualität angesehen werden, sofern ein solcher Kauf nicht zur Folge hat, dass mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds aus Anlagen bestehen, deren Rating unter „Investment Grade“ liegt oder die, sofern sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter und den Unteranlageverwaltern als von vergleichbarer Qualität angesehen werden. Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) erzielen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] (Handel eingestellt am 21. Juni 2022)

Anlageziel – Erzielung hoher laufender Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in hochverzinsliche Schuldtitel, die auf Euro lauten, an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Emittenten aus aller Welt begeben werden.

Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er in Schuldtitel, die von nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, Unternehmensanleihen, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Brady-Anleihen, Anleihen mit anpassbarem Zinssatz, Anleihen mit variablem Zinssatz, Anleihen mit geplanter Tilgung, Principal-Only-Anleihen, Eurobonds, Eurodollar-Anleihen und Yankee-Dollar-Instrumente, PIK-Anleihen, Nullkuponanleihen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften begeben werden, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, hypothekenbesicherte Wertpapiere und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, investiert.

Vorbehaltlich der vorstehenden Beschränkungen dürfen die übrigen Vermögenswerte des Fonds (maximal ein Drittel seines Nettoinventarwerts) gehalten werden in (i) Schuldtiteln mit einem Rating von über BB+ von S&P oder einem gleichwertigen Rating einer anderen NRSRO oder Wertpapieren ohne Rating, die vom Anlageverwalter und den Unteranlageverwaltern als gleichwertig erachtet werden, (ii) Vorzugsaktien und Optionsscheine, sofern diese Anlagen mit dem Anlageziel des Fonds, hohe laufende Erträge zu erzielen, vereinbar sind, sowie (iii) Liquidität oder kurzfristige Geldmarktinstrumente mit Restlaufzeiten von 13 Monaten oder weniger, bei denen es sich um Instrumente handelt, die normalerweise auf dem Geldmarkt gehandelt werden und liquide sind (d. h. innerhalb von sieben Geschäftstagen zu einem Preis, der ihrem aktuellen Wert nahe kommt, in Bargeld umgewandelt werden können); dazu können die folgenden Anlagen mit Laufzeiten von 13 Monaten oder weniger gehören: (a) Schuldtitel, die von den nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, (b) Unternehmensschuldtitel, darunter frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, (c) hypothekenbesicherte Wertpapiere, (d) strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, (e) verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, (f) Optionsscheine, (g) forderungsbesicherte Wertpapiere und (h) umgekehrte Pensionsgeschäfte (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften). Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) erzielen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert in (i) Schuldtitel, Wandelanleihen, Vorzugsaktien und Optionsscheine, die an geregelten Märkten auf der ganzen Welt, einschließlich der Schwellenländer, notiert sind oder gehandelt werden, (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei solche Anlagen zum Zweck des Aufbaus eines Engagements in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten oder anderweitig zur Verfolgung des Anlageziels und der Anlagepolitik des Fonds erfolgen, und (iii) Derivate. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile von offenen Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds kann in Unternehmensschuldtitel wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, sofern der Fonds direkt in solche zugrunde liegenden festverzinslichen Wertpapiere investieren darf, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt; hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung), Schuldtitel, die von nationalen Regierungen und ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere und Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen investieren.

Der Fonds kann in erheblichem Umfang (sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung) in bestimmte Arten von Finanzderivaten investieren. Der Fonds hat ein hohes Leverage-Limit. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlageziel – Erzielung einer Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert in ein weltweit diversifiziertes Portfolio aus Schuldtiteln und Derivaten, die ein Engagement in Schuldtiteln, Zinssätzen, Währungen und Indizes ermöglichen. Der Fonds kann in Unternehmensschuldtiteln wie frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen und bedingte Wandelanleihen investieren (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, Geldmarktinstrumente, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, hypotheckenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung), Schuldtitel, die von nationalen Regierungen und ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere sowie Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen investieren. Verbrieft Beteiligungen an Krediten sind börsennotierte Wertpapiere und die Anlage in solche Wertpapiere ist auf 50 % des Nettoinventarwerts des Fonds begrenzt.

Der Anlageverwalter und die Unteranlageverwalter gehen davon aus, dass die durchschnittliche Duration der Anlagen des Fonds zwischen 0 und 10 Jahren liegen wird, abhängig von der Prognose des Anlageverwalters und der Unteranlageverwalter für Zinssätze und Renditen. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren, einschließlich offener börsengehandelter Fonds (einschließlich börsengehandelter Aktienfonds).

Der Fonds kann in großem Umfang in bestimmte Arten von Derivaten investieren. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 65 % seines Nettoinventarwerts in hypotheckenbesicherte Wertpapiere („MBS“) und forderungsbesicherte Wertpapiere („ABS“), die von nichtstaatlichen Emittenten begeben werden und nicht von staatlich geförderten US-Einrichtungen wie FNMA oder FHLMC und/oder von Behörden der US-Regierung wie GNMA garantiert sind. Solche Wertpapiere sind an geregelten Märkten überall auf der Welt, auch in Schwellenländern, notiert oder werden dort gehandelt.

Zu den Arten von MBS, in die der Fonds investieren kann, gehören durch Wohnhypothecken besicherte Interest-Only-, Inverse-Interest-Only- oder Principal-Only-MBS, durch Gewerbehypothecken besicherte MBS, Collateralised Mortgage Obligations („CMOs“) und von Real Estate Mortgage Investment Conduits begebene Wertpapiere („REMICs“), Re-securitized Real Estate Mortgage Investment Conduits („Re-REMICs“) (die den Vorschriften der Securitisation Regulation entsprechen, bis höchstens 7,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds), Pass-Through-Zertifikate, Hypothekentermingeschäfte oder „To be announced“-Transaktionen, Collateralised Loan Obligations, die durch Gewerkekredite besichert sind, Credit-Linked-Notes und Mortgage Servicing Rights-Wertpapiere. Pass-Through-Zertifikate sind festverzinsliche Wertpapiere, bei denen Zertifikate ausgegeben werden, die Anteile an einem Pool von Hypotheken oder hypotheckenbesicherten Wertpapieren verbiefen.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 35 % seines Nettoinventarwerts investieren in: hypotheckenbesicherte Wertpapiere, die von einer Behörde ausgegeben oder garantiert werden, forderungsbesicherte Wertpapiere, die von einer Behörde garantiert werden, von Unternehmen begebene oder garantierte Schuldtitel wie Schuldscheine, Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldscheine und Schuldverschreibungen, verbrieft Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, Vorzugsaktien, Commercial Paper, Einlagenzertifikate, Termineinlagen, Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte (die für Zwecke des effizienten Portfoliomanagements eingesetzt werden können) und Dollar-Rolls, Bankakzepte, einschließlich Schuldtitel von Unternehmen, die sich im Besitz oder teilweise im Besitz einer Regierung, ihrer Gebietskörperschaften oder Behörden befinden oder deren Verbindlichkeiten von dieser bzw. diesen garantiert werden, Schuldtitel, die von zentralstaatlichen, Landes-, Kommunal- und Stadtregierungen und deren Behörden, Kommunen und Einrichtungen begeben oder garantiert werden, Commercial Paper, Liquidität und Geldmarktinstrumente. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen (einschließlich offener börsengehandelter Fonds) im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in erheblichem Umfang (sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung) in bestimmte Arten von Derivaten investieren. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs) und Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

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

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in hypotheckenbesicherte Wertpapiere (einschließlich Collateralised Mortgage Obligations), die (i) auf US-Dollar lauten, (ii) von der US-Regierung, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden und von staatlich geförderten Einrichtungen begeben oder garantiert werden und (iii) an geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden und in Anhang III des Prospekts aufgeführt sind. Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in Schuldverschreibungen des US-Finanzministeriums, von US-Behörden begebene oder garantierte Schuldverschreibungen und auf US-Dollar lautende Zahlungsmitteläquivalente investieren oder halten, einschließlich Geldmarktfonds und umgekehrte Pensionsgeschäfte (ausschließlich für ein effizientes Portfoliomanagement). Der Fonds kauft nur Schuldtitel, die über ein Rating von mindestens B- von S&P oder ein vergleichbares Rating von einer anderen anerkannten Ratingagentur verfügen, oder die, wenn sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter als gleichwertig eingeschätzt werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds wird nicht über 100 % seines Nettoinventarwerts hinaus gehandelt. Das maximale Engagement des Fonds in Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs) und Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel und Schuldtitel von supranationalen Organisationen, die an geregelten Märkten im Vereinigten Königreich und anderen geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und auf Pfund Sterling lauten.

Der Fonds darf in Unternehmensschuldtitel investieren, wie frei übertragbare Schuldscheine, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften.

Darüber hinaus darf der Fonds in Wertpapiere, die von nationalen Regierungen und deren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere, Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, verbrieft Beteiligungen an Krediten, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, hypotheckenbesicherte Wertpapiere (einschließlich Collateralised Mortgage Obligations) und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, investieren. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] – (Fortsetzung)

unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des ICE BofA Sterling Non-Gilts Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten. Darüber hinaus strebt der Fonds eine jährliche Verringerung der gewichteten durchschnittlichen CO₂-Intensität an.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel, die (i) auf US-Dollar lauten und (ii) an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert oder gehandelt werden.

Zu den Arten von Unternehmensschuldtiteln, in die der Fonds investieren darf, gehören frei übertragbare Schuldscheine, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen, Schuldverschreibungen, nicht wandelbare Schuldverschreibungen, bedingte Wandelanleihen (bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in bedingte Wandelanleihen investiert werden), Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzente von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften.

Darüber hinaus kann der Fonds in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen (einschließlich STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere), ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, sowie in Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, verbriefte Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um frei übertragbare Wertpapiere handelt, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, hypothekenbesicherte Wertpapiere (einschließlich Collateralised Mortgage Obligations), forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Vorschriften der irischen Zentralbank) und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1) (e) der UCITS Regulations. Solche Anlagen erfolgen zum Zweck des Aufbaus eines Engagements in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten oder anderweitig zur Verfolgung des Anlageziels und der Anlagepolitik des Fonds. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds kann in bestimmte Arten von Derivaten investieren und durch den Einsatz von Derivaten eine Hebelwirkung von bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts erzielen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus. Daten von MSCI sind die Hauptquelle für ESG-Ratings. Der Portfoliomanager kann sich jedoch für den Fall, dass keine ESG-Ratingdaten von MSCI verfügbar sind, auf ein relevantes ESG-Rating von Western Asset für den Emittenten stützen. Im Rahmen der Bewertung nutzt der Fonds ESG-Daten Dritter, unter anderem von MSCI und der Weltbank, um unter anderem die CO₂-Intensität für Unternehmens- bzw. staatliche Emittenten zu messen. Die Ausrichtung an den UN-SDGs wird mithilfe des proprietären Rahmenwerks von Western Asset gemessen, das auf den von Drittanbietern beschafften Daten basiert.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg US Credit Index (die „Benchmark“) liegt. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten. Darüber hinaus strebt der Fonds eine jährliche Verringerung der gewichteten durchschnittlichen CO₂-Intensität an.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt.

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

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Kapitalzuwachs und Erträge.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden und von Emittenten mit Sitz auf der ganzen Welt begeben werden. Zu den Arten von Schuldtiteln, in die der Fonds investieren darf, gehören: Schuldtitel, die von der US-Regierung, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, Schuldtitel, die von anderen nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben werden, Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, Unternehmensschuldtitel, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- oder variabel verzinslicher Anleihen, Wandelanleihen, nicht wandelbarer Schuldscheine, Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzente von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften sowie hypothekenbesicherte und forderungsbesicherte Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind.

Der Fonds kann ferner bis zu 75 % seines Nettoinventarwerts in hypotheken- und forderungsbesicherten Wertpapieren anlegen. Die hypothekenbesicherten und forderungsbesicherten Wertpapiere und Credit-Linked Notes, in die der Fonds investiert, können eingebettete Derivate und/oder Leverage enthalten. Der Fonds kann dadurch gehebelt sein, vorbehaltlich der nachstehend aufgeführten Obergrenzen für die Hebelung.

Bis zu 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in wandelbare Schuldtitel investiert werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Vorzugsaktien oder andere Beteiligungspapiere einschließlich Optionsscheine investiert werden (maximal 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Optionsscheine investiert werden). Bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Vorbehaltlich der vorstehenden Beschränkungen darf der Fonds außerdem insgesamt nicht mehr als 30 % seines Nettoinventarwerts in nicht öffentlich gehandelte Wertpapiere, Rule-144A-Wertpapiere, Nullkuponwertpapiere (mit Ausnahme von Wertpapieren, die von der Regierung der Vereinigten Staaten und ihren Behörden begeben werden) und Geldmarktinstrumente investieren.

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamtrendite durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel und Schuldtitel von supranationalen Organisationen, die (i) auf US-Dollar, den japanischen Yen, Euro, Pfund Sterling und verschiedene andere Währungen lauten und (ii) an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Darüber hinaus kann der Fonds in Wertpapiere investieren, die von nationalen Regierungen (einschließlich STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere), ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, sowie in Wertpapiere supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Anleihen und Schuldverschreibungen, umgekehrte Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften) und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1) (e) der UCITS Regulations.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

Vorbehaltlich der vorgenannten Beschränkung dürfen bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in wandelbare Schuldtitel und/oder Schuldtitel mit der Option zum Erwerb von Beteiligungspapieren investiert werden. Der Fonds wird keine Beteiligungspapiere oder Eigentumsrechte an Beteiligungspapieren erwerben, mit Ausnahme von (1) Vorzugsaktien bis maximal 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds und (2) Beteiligungspapieren, die durch Umwandlung von wandelbaren Schuldtiteln oder durch Kapitalmaßnahmen von Emittenten (z. B. die Ausgabe von Aktien als Ersatz für zuvor ausgegebene Schuldtitel) erworben werden. Nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in anderen Währungen als dem US-Dollar investiert sein. Vorbehaltlich der vorstehenden Beschränkungen darf der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Die Wertpapiere, aus denen sich das Anlageuniversum des Fonds zusammensetzt, werden mithilfe eines proprietären Systems und des ESG-Rahmenwerks von MSCI bewertet, um das ESG-Rating des gesamten Anlageuniversums und einzelner Emittenten und ihrer Wertpapiere zu bestimmen. Anschließend wählt der Anlageverwalter unter Berücksichtigung der Anlagepolitik des Fonds und der ESG-Ratings der Emittenten der betreffenden Wertpapiere Anlagen für den Fonds aus.

Der Fonds ist bestrebt, in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, die einen annualisierten absoluten Rückgang des CO₂-Fußabdrucks gegenüber dem Vorjahr anstreben, und insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Portfolio-CO₂-Intensität erreichen, die mindestens 20 % unter der des Bloomberg Global Aggregate Corporate Index (Hedged) USD (die „Benchmark“) liegt. Der Anlageverwalter definiert den CO₂-Fußabdruck als den gewichteten Durchschnitt der CO₂-Emissionsintensität der im Portfolio gehaltenen Wertpapiere. Die CO₂-Emissionsintensität bezieht sich auf die Scope-1- und Scope-2-Treibhausgasemissionen eines Emittenten.

Wie in der Anlagepolitik dargelegt, wird das Fondsportfolio beständig ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von BBB oder haben. Nach der Methodik von MSCI entspricht dies einem im Branchenvergleich durchschnittlichen oder besseren Rating, was auf eine glaubwürdige Ausrichtung auf ESG-Merkmale schließen lässt. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere von Emittenten investieren, die zum Zeitpunkt des Kaufs ein MSCI ESG-Rating von BB oder niedriger haben. Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter ESG-Ratings auf mindestens 90 % der Wertpapiere an, in die der Fonds investiert, außer bei Hochzinsanleihen und Schwellenländer-Schuldtiteln, bei denen die ESG-Ratings auf mindestens 75 % dieser speziellen Anlagen angewendet werden. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Darüber hinaus wird der Fonds versuchen, sich bei seinen Anlagen stärker als die Benchmark auf Wertpapiere von Emittenten zu konzentrieren, deren Aktivitäten mindestens zu einem von acht ausgewählten Zielen für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen („UN-SDGs“) beitragen (zusammen „UN-SDG-Emittenten“).

Der Fonds schließt Anlagen in Wertpapieren der folgenden Emittenten aus:

- Emittenten die, wie vom Anlageverwalter unter Berücksichtigung der im Prospektabschnitt „Nachhaltigkeitsrisiko“ enthaltenen Governance-Faktoren festgelegt, keine guten Governance-Praktiken anwenden,
- Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit Tabakproduktion und/oder -vertrieb erzielen,
- Emittenten, die mehr als 10 % ihres Umsatzes erzielen aus:
 - zivilen Schusswaffen (Herstellung/Lieferung),
 - jeglicher Beteiligung an konventionellen Waffen,
 - der Förderung von Kraftwerkskohle (Produktion/Vertrieb),
- Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Produktion von Atomwaffen erzielen,
- Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden,
- Emittenten, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden, und
- Staaten und/oder staatliche Emittenten, die gemäß dem Freedom House Index unzureichend abschneiden.

Der Anlageverwalter wird sich durch Gespräche mit dem Management mit Emittenten über ESG-Praktiken auseinandersetzen. Der Prozess der aktiven Mitwirkung (Engagement) des Anlageverwalters soll sich an den Grundsätzen des Global Compact der Vereinten Nationen orientieren.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamterträge durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die (i) an geregelten Märkten hauptsächlich in den folgenden Ländern notiert sind oder gehandelt werden und (ii) auf Währungen der folgenden Länder lauten oder deren Emittenten hauptsächlich in den folgenden Ländern ansässig sind: USA, Kanada, Australien, Japan, Österreich, Belgien, Finnland, Frankreich, Deutschland, Griechenland, Irland, Italien, Niederlande, Portugal, Spanien, Dänemark, Schweden, die Schweiz, das Vereinigte Königreich, Neuseeland, Norwegen, Ungarn, Polen und die Tschechische Republik. Der Fonds darf auch in Schuldtitel investieren, die an geregelten Märkten in anderen Industrieländern notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt.

Alle vom Fonds erworbenen Schuldtitel weisen entweder ein Investment-Grade-Rating oder, falls kein Rating vorliegt, nach Einschätzung des Anlageverwalters zum Zeitpunkt des Erwerbs eine vergleichbare Qualität auf. Wenn eine auf diese Weise erworbene Anlage nach dem Kauf auf ein Rating unterhalb von „Investment Grade“ herabgestuft wird, kann der Anlageverwalter nach eigenem Ermessen den Schuldtitel weiter halten, wenn er der Auffassung ist, dass dies im besten Interesse der Anteilhaber ist. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel von Emittenten investieren, die in Ländern ansässig sind, auf die die folgenden beiden Kriterien zutreffen: (i) Die auf Landeswährung lautenden langfristigen Schuldtitel des Landes haben ein Rating unter A- von S&P oder ein gleichwertiges Rating aller NRSROs, die die Schuldtitel bewerten, und (ii) das Land ist im Citigroup World Government Bond Index nicht vertreten. Bis zu 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in wandelbare Schuldtitel investiert werden und bis zu 10 Prozent des Nettoinventarwerts des Fonds in Beteiligungspapiere und/oder Optionsscheine. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Optionsscheine investiert werden. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds wird nicht mehr als 100 % seines Nettoinventarwerts (berechnet nach dem Commitment-Ansatz) gehebelt, dies gilt auch für synthetische Shortpositionen.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen vielschichtigen Ansatz an, um die ESG-Faktoren bei mindestens 90 % seiner aktuellen und künftigen Bestände zu bewerten. Dieser Prozess basiert auf einem eigenen System für das Scoring oder Ranking von Emittenten sowie der Nutzung von Rohdaten, Kennzahlen und Analysen externer Anbieter. Die Ergebnisse dieser Analyse bilden die Grundlage für den Portfolioausschluss, bei dem das unterste Dezil des investierbaren Universums, wie durch die Umwelt- und Sozialfaktoren für staatliche Themen definiert, aussortiert und das zweitniedrigste Dezil automatisch zu Kandidaten für ein Engagement wird.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)

Der Fonds sieht keinen spezifischen Sektorauschluss für staatliche Emittenten vor, die fossile Brennstoffe und/oder Rohstoffe exportieren. Allerdings können staatliche Emittenten, die in diesen Sektoren engagiert sind, ausgeschlossen werden, wenn ihre Scores für E und S gemäß der angewendeten ESG-Methodik im unteren Dezil liegen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlageziel – Erzielung positiver Renditen unabhängig von Marktzyklen.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 Prozent seines Nettoinventarwerts in (i) Schuldtitel, wandelbare Wertpapiere und Vorzugsaktien, die an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden, (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations und (iii) Derivate, die ein Engagement in beliebigen oder allen der folgenden Wertpapiere bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und Rentenindizes, die den Zulassungsanforderungen der Zentralbank entsprechen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Vorschrift 68(1)(e) der OGAW-Vorschriften investieren, und diese Anlagen müssen dem Zweck dienen, ein Engagement in den in der Anlagepolitik beschriebenen Arten von Instrumenten zu bieten oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen.

Der Fonds kann in erheblichem Umfang in bestimmte Arten von Derivaten investieren, sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung, wie im Abschnitt „Anlagetechniken und -instrumente und Finanzderivate“ des Prospekts beschrieben, unter anderem Optionen, Futures und Optionen auf Futures, Devisenterminkontrakte und Optionsscheine. Umgekehrte Pensionsgeschäfte, deren Basisinstrumente Schuldtitel sind, können für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden. Der Fonds kann auch Swaps einsetzen, unter anderem Zins-, Total-Return- und Inflationsswaps. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts.

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

Anlageziel – Erzielung hoher Erträge. Die Erzielung von Kapitalzuwachs ist ein sekundäres Ziel.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel, die vom Anlageverwalter als hochverzinslich gelten und an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden. Höhere Renditen sind im Allgemeinen bei Wertpapieren mit einem Rating von BB+ oder niedriger von S&P oder Ba1 oder niedriger von Moody's oder mit einem gleichwertigen Rating einer anderen NRSRO oder bei Wertpapieren ohne Rating, die vom Anlageverwalter als gleichwertig angesehen werden, zu erwarten. Schuldtitel mit einem Rating unterhalb von „Investment Grade“ werden von Ratingagenturen im Hinblick auf die Fähigkeit des Emittenten, Zinsen und Kapital zurückzuzahlen, als deutlich spekulativ eingestuft und können mit einem erheblichen Risiko der Anfälligkeit für ungünstige Bedingungen verbunden sein. Der Fonds kann in Schuldtitel investieren, die von Moody's mit C oder von S&P mit D bewertet wurden. Diese Ratings besagen, dass es sich bei den Schuldtiteln um hochspekulative Wertpapiere handelt und sie möglicherweise in Bezug auf Kapital und Zinsen in Zahlungsverzug sind oder geraten könnten. Der Anlageverwalter stützt sich bei Anlageentscheidungen nicht ausschließlich auf die Ratings bewerteter Wertpapiere, sondern wendet stattdessen einen quantitativen und qualitativen Prozess an, um zu bestimmen, welche Wertpapiere einen Wert bieten. Zu den Faktoren, die dabei helfen zu bestimmen, welche Unternehmensschuldtitel einen Wert bieten, gehören die Wirtschaftlichkeit des Emittenten, der relative Wert der Währung der Wertpapiere, die Qualität des Geschäftsmodells des Emittenten und die Position der Wertpapiere in der Kapitalstruktur des Emittenten, die Qualität der Covenants in den Wertpapieren und die wahrscheinliche Realisierungsquote der Wertpapiere bei einem Stressereignis. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in CoCo-Anleihen investiert werden. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher ESG-Aspekte, die die Wertentwicklung einer Anlage beeinflussen können. Der Fonds kann bis zu 100 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere investieren, die in Schwellenmarktländern begeben werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Im Hinblick auf das Währungsengagement darf der Anlageverwalter keine Netto-Shortpositionen in einer Währung oder eine Longposition von mehr als 105 % des Nettoinventarwerts des Fonds eingehen.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlageziel – Maximierung der Gesamterträge durch Erträge und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel, die an geregelten Märkten auf der ganzen Welt, einschließlich Schwellenländern, notiert sind oder gehandelt werden und wie in Anhang III des Prospekts dargelegt.

Zu den Anlagen des Fonds können folgende gehören: - (i) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden (einschließlich inflationsgeschützter Wertpapiere), (ii) Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, fest- oder variabel verzinsliche Anleihen und Schuldverschreibungen, (iii) Unternehmensschuldtitel von Emittenten (gestreut über eine Vielzahl von Branchen, unter anderem Kommunikation, Konsumgüter, Energie, Finanzen, Industrie, Technologie, Versorger usw.), die ihren Sitz an geregelten Märkten haben oder deren Wertpapiere an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- oder variabel verzinsliche Anleihen (einschließlich Nullkuponanleihen), wandelbare und nicht wandelbare Schuldscheine, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften und (iv) hypotheckenbesicherte Wertpapiere (einschließlich Collateralised Debt Obligations) und forderungsbesicherte Wertpapiere, Vorzugsaktien und andere offene Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher ESG-Aspekte, die die Wertentwicklung einer Anlage beeinflussen können. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 25 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds wird nicht mehr als 100 % seines Nettoinventarwerts gehebelt, dies gilt auch für synthetische Shortpositionen. Vorbehaltlich dieser Beschränkung wird der Fonds voraussichtlich netto long sein. Im Hinblick auf das Währungsengagement darf der Anlageverwalter keine Netto-Shortpositionen in einer Währung oder eine Longposition von mehr als 105 % des Nettoinventarwerts des Fonds eingehen.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlageziel – Maximierung der Ertragsrendite unter allen Marktbedingungen bei gleichzeitigem Kapitalerhalt.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert in: (i) Schuldtitel und wandelbare Wertpapiere, die an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden, (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations und (iii) Derivate, die ein Engagement in beliebigen oder allen der folgenden Wertpapiere bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen, Aktien und Indizes (einschließlich Renten-, Aktien- und Rohstoffindizes), die den Zulassungsanforderungen der Zentralbank entsprechen. Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel und Derivate, die ein Engagement in Schuldtiteln ermöglichen. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in CoCo-Anleihen investiert werden. Der Fonds investiert mindestens 85 % seines Nettoinventarwerts in US-Dollar. Wenn sich jedoch Gelegenheiten bieten, kann dieser Betrag von Zeit zu Zeit mindestens 80 % in US-Dollar betragen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren. Umgekehrte Pensionsgeschäfte, deren Basisinstrumente Schuldtitel sind, können für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten und Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)

Der Anlageverwalter wendet einen vielschichtigen Ansatz an, um die ESG-Faktoren bei mindestens 90 % seiner aktuellen und 80 % seiner künftigen Bestände zu bewerten. Dieser Prozess basiert auf einem eigenen System für das Scoring oder Ranking von Emittenten sowie der Nutzung von Rohdaten, Kennzahlen und Analysen externer Anbieter. Die Ergebnisse dieser Analyse bilden die Grundlage für den Ausschluss aus dem Portfolio, wobei das (durch Umwelt- und soziale Faktoren für sowohl staatliche als auch für Unternehmensbelange definierte) unterste Dezil des Universums möglicher Anlagen verworfen wird und die Emittenten im zweitniedrigsten Dezil automatisch zu Kandidaten für ein Engagement werden. Zudem überwacht der Anlageverwalter aktuelle und künftige Bestände auf Verschlechterungen und Verbesserungen der ökologischen und sozialen Faktoren.

Der Fonds sieht keinen spezifischen Sektorausschluss für fossile Brennstoffe vor. Unternehmensemittenten aus diesem Sektor sind jedoch ausgeschlossen, wenn ihre ESG-Scores laut der angewendeten ESG-Methodik ins unterste Dezil fallen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Gesamtertritte durch ein hohes Maß an Erträgen und Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds versucht, sein Anlageziel vor allem durch einen flexiblen Anlageansatz für Schuldtitel von Emittenten mit Sitz in einem beliebigen Land zu erreichen, und zwar sowohl durch Long- als auch Shortengagements (über Derivate). Der Fonds wird maximal 25 % seines Nettoinventarwerts in hypotheckenbesicherte Wertpapiere in einem einzelnen Land (ohne USA) investieren. Der Fonds wird außerdem insgesamt maximal 40 % seines Nettoinventarwerts in hypotheckenbesicherte Wertpapiere von Nicht-US-Ländern investieren. Der Fonds wird maximal 10 % seines Nettoinventarwerts in Collateralised Debt Obligations und Collateralised Loan Obligations investieren. Der Anlageansatz des Anlageverwalters umfasst die Analyse wesentlicher ESG-Aspekte, die die Wertentwicklung einer Anlage beeinflussen können. Zu den Arten von Schuldtiteln, in die der Fonds investieren kann, gehören: hypotheckenbesicherte Agency- und Non-Agency-Wertpapiere, die als Schuldtitel strukturiert sind, forderungsbesicherte Wertpapiere, Unternehmensschuldtitel, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Wandelanleihen und nicht wandelbare Anleihen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzente von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften, Schuldtitel, die von nationalen Regierungen, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, Schuldtitel supranationaler Organisationen wie frei übertragbare Schuldscheine, Anleihen und Schuldverschreibungen, strukturierte Schuldverschreibungen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in festverzinslichen Wertpapieren bestehen kann, verbrieftete Beteiligungen an Darlehen, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, Eurodollar-Anleihen und Yankee-Dollar-Instrumente (einschließlich vorrangiger und nachrangiger Schuldverschreibungen) und Rule-144A-Wertpapiere. Die strukturierten Schuldverschreibungen, in die der Fonds investieren wird, können eingebettete Derivate enthalten und der Fonds kann dadurch gehebelt sein. Die Hebelwirkung des Fonds, berechnet anhand der Summe der Nominalwerte der vom Fonds gehaltenen Derivate, wird weniger als 700 % des Nettoinventarwerts des Fonds betragen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Anlageziel – Erzielung von Erträgen sowie langfristigen Kapitalgewinnen.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmensschuldtitel, die vom Anlageverwalter als hochrentierlich erachtet werden und an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt, einschließlich Direktanlagen oder indirekte Anlagen über Derivate auf solche Wertpapiere, wobei der Fonds mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts direkt in solche Wertpapiere investiert.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Geldmarktinstrumente investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, sowie in Schuldtitel der im Prospekt aufgeführten Arten, die nicht an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden. Es dürfen jedoch höchstens 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Schuldtitel investiert werden, die nicht an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden. Bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in wandelbare Schuldtitel investiert werden. Bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Vorzugsaktien investiert werden. Bis zu 20 % können in Beteiligungspapiere einschließlich Optionsscheine investiert werden (maximal 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Optionsscheine investiert werden). Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann sich zu Zwecken eines effizienten Portfoliomanagements und vorbehaltlich der Zentralbankvorschriften an umgekehrten Pensionsgeschäften beteiligen. Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps und Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs), basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 100 % seines Nettoinventarwerts. Im Hinblick auf das Währungsengagement darf der Anlageverwalter keine Netto-Shortpositionen in einer Währung oder eine Longposition von mehr als 105 % des Nettoinventarwerts des Fonds eingehen.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlageziel – Erzielung positiver Renditen unabhängig von Marktzyklen.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in: (i) Schuldtitel, wandelbare Wertpapiere und Vorzugsaktien, die an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt, (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations und (iii) Derivate, die ein Engagement in beliebigen oder allen der folgenden Wertpapiere bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und Rentenindizes, die den Zulassungsanforderungen der Zentralbank entsprechen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen investieren, und diese Anlagen müssen dem Zweck dienen, ein Engagement in den hier beschriebenen Arten von Instrumenten zu bieten oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Umgekehrte Pensionsgeschäfte, deren Basisinstrumente Schuldtitel sind, können für ein effizientes Portfoliomanagement eingesetzt werden.

Der Fonds kann in erheblichem Umfang in bestimmte Arten von Derivaten investieren, sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung, unter anderem in Optionen, Futures und Optionen auf Futures, Devisenterminkontrakte und Optionsscheine. Der Fonds kann auch Swaps einsetzen, unter anderem Zins-, Total-Return-, Credit-Default- und Inflationsswaps.

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Anlageziel – Maximierung der Ertragsrendite unter allen Marktbedingungen bei gleichzeitigem Kapitalerhalt.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert in: (i) Schuldtitel und wandelbare Wertpapiere (einschließlich bedingter wandelbarer Wertpapiere, bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds), die an geregelten Märkten überall auf der Welt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt, (ii) Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations und (iii) Derivate, die ein Engagement in beliebigen oder allen der folgenden Wertpapiere bieten: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und Indizes (einschließlich Renten- und Rohstoffindizes), die den Zulassungsanforderungen der Zentralbank entsprechen. Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel und Derivate, die ein Engagement in Schuldtiteln ermöglichen. Der Fonds investiert mindestens 85 % seines Nettoinventarwerts in US-Dollar. Wenn sich jedoch Gelegenheiten bieten, kann dieser Betrag von Zeit zu Zeit mindestens 80 % in US-Dollar betragen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren, und diese Anlagen müssen dem Zweck dienen, ein Engagement in den hier beschriebenen Arten von Instrumenten zu bieten oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen.

Der Anlageverwalter versucht, das Anlageziel zu erreichen, indem er in Schuldtitel und/oder schuldtitelbezogene Emissionen von Unternehmen und Ländern (wie oben genannt) investiert, die derzeit klare Pläne zur Förderung einer nachhaltigen und gerechten Wirtschaft umsetzen oder voraussichtlich umsetzen werden, wie vom Anlageverwalter bestimmt.

Der Fonds kann in erheblichem Umfang in bestimmte Arten von Derivaten investieren, sei es zu Anlagezwecken oder zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung, wie im Abschnitt „Anlagetechniken und -instrumente und Finanzderivate“ des Prospekts beschrieben, unter anderem Optionen, Futures und Optionen auf Futures, Credit-Linked Notes, Devisenterminkontrakte und Optionsscheine. Der Fonds kann auch Swaps einsetzen, unter anderem Zins-, Total-Return-, Inflations- und Credit-Default-Swaps. Soweit der Fonds Derivate einsetzt, und vorbehaltlich der hier festgelegten Beschränkung, wird er dies tun, um ein Engagement in beliebigen oder allen der folgenden Wertpapiere

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] – (Fortsetzung)

aufzubauen: Schuldtitel, Zinssätze, Währungen und Indizes (einschließlich Renten- und Rohstoffindizes), die den Zulassungsvoraussetzungen der Zentralbank entsprechen. In Bezug auf solche Arten von Anlagewerten kann der Fonds Shortpositionen in Derivaten oder Longpositionen in Derivaten eingehen, bei denen ein direkter Kauf nicht möglich oder weniger effizient wäre.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der Taxonomieverordnung. Daher kann es sein, dass der Mindestanteil der Investitionen, die als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomieverordnung gelten, gleich null ist. Gemäß seiner ESG-Methodik kann der Fonds jedoch Investments halten, die einen Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel leisten.

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere von Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung, die (1) ihren Sitz oder ihre Hauptniederlassung in den Vereinigten Staaten haben oder den überwiegenden Teil ihrer Aktivitäten in den Vereinigten Staaten ausüben und (2) an geregelten Märkten gemäß Anhang III des Prospekts notiert sind oder gehandelt werden.

Der Fonds investiert in Stammaktien und Vorzugsaktien. Vorbehaltlich der vorgenannten Anlagebeschränkung für Beteiligungspapiere kann der Fonds auch in Schuldtitel, die von in den USA ansässigen Emittenten begeben oder garantiert werden, unter anderem von der US-Regierung, ihren Gebietskörperschaften oder Behörden, Unternehmensschuldtitel, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, einschließlich frei übertragbarer Schuldscheine, Schuldverschreibungen, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte von Industrie-, Versorgungs- und Finanzunternehmen, Geschäftsbanken oder Bankholdinggesellschaften und Optionsscheine investieren. Der Fonds kauft nur Schuldtitel, die zum Zeitpunkt des Kaufs über ein Investment-Grade-Rating verfügen. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

FTGF ClearBridge Value Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert hauptsächlich in Wertpapiere von US-Emittenten, die nach Ansicht des Anlageverwalters unterbewertet sind. Der Fonds kann zudem bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapieren von Nicht-US-Emittenten anlegen. Mindestens 50 % des Nettoinventarwerts des Fonds werden in Beteiligungspapiere investiert. Der Fonds kann außerdem bis zu 5 % seines Nettoinventarwerts in Anteile offener Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozess an, um das ESG-Profil eines Unternehmens zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings anhand seines ESG-Ratingsystems mit quantitativer und qualitativer Beurteilung. Dieses System hat vier Ratingstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B werden den Unternehmen basierend auf ihrer Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen. Der Fonds kann in Unternehmen investieren, die nach dem eigenen ESG-Rating-System ein „B“-Rating erhalten. Allerdings wird der Anteil dieser Unternehmen am Fonds im Vergleich zu Unternehmen mit einem „A“-Rating und höher geringer sein. Darüber hinaus wird sich der Anlageverwalter regelmäßig direkt mit den Unternehmen mit einem B-Rating, in die der Fonds investiert, austauschen, um die wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Merkmale dieser Unternehmen zu verbessern.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind, und in
- Unternehmen, deren Umsatzerlöse zu mindestens 5 % aus Tabakwaren stammen.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Fondsportfolios an, um zu erreichen, dass das ESG-Rating des Portfolios beständig höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere von US-Unternehmen, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Der Fonds investiert in Stammaktien, Vorzugsaktien und aktiengebundene Wertpapiere. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Fonds kann auch in bestimmte Arten von Derivaten investieren, jedoch nur zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung. Der Anlageverwalter kann die Allokation des Fonds in Geldmarktinstrumenten und ergänzenden liquiden Mitteln erhöhen, wenn nach Ansicht des Anlageverwalters die Marktbewertung zu hoch ist.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozess an, um das ESG-Profil eines Unternehmens zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings anhand seines ESG-Ratingsystems mit quantitativer und qualitativer Beurteilung. Dieses System hat vier Bewertungsstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B, die den Unternehmen basierend auf ihrer Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen werden. Unternehmen mit einem B-Rating im proprietären ESG-Ratingsystem werden für eine Anlage im Fonds nicht berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und im Bergbau, die nach Ansicht von Analysten keine eindeutig besseren ESG-Merkmale aufweisen als andere ähnliche Unternehmen, und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)

Der Fonds ist nicht in Unternehmen engagiert, die Tabak und Tabakprodukte herstellen, kann jedoch in Unternehmen investieren, die indirekt höchstens 5 % ihrer Umsätze mit Tabak erwirtschaften. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Fondsportfolios an, um zu erreichen, dass das ESG-Rating des Portfolios beständig höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere einer konzentrierten Gruppe von US-Unternehmen, die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Die Kernpositionen des Fonds sind Large-Cap-US-Firmen mit dominanter Stellung in ihren jeweiligen Branchen, globaler Ausrichtung und langer Performance-Historie. Zu den Anlagen des Fonds gehören Stammaktien und in geringerem Umfang Vorzugsaktien und aktienähnliche Wertpapiere, die von US-amerikanischen Unternehmen mit großer Marktkapitalisierung begeben werden oder mit diesen in Zusammenhang stehen und von denen angenommen wird, dass sie attraktive Möglichkeiten für Wertzuwachs bieten. Der Fonds investiert nicht in Wertpapiere, die an geregelten Märkten in Schwellenländern, europäischen Schwellenländern oder Schwellenländern des Asien-Pazifik-Raums notiert sind oder gehandelt werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozess an, um das ESG-Profil eines Unternehmens zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings anhand seines ESG-Ratingsystems mit quantitativer und qualitativer Beurteilung. Dieses System hat vier Bewertungsstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B, die den Unternehmen basierend auf ihrer Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen werden. Unternehmen mit einem B-Rating im proprietären ESG-Ratingsystem werden für eine Anlage im Fonds nicht berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und im Bergbau, die nach Ansicht von Analysten keine eindeutig besseren ESG-Merkmale aufweisen als andere ähnliche Unternehmen, und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind.

Der Fonds ist nicht in Unternehmen engagiert, die Tabak und Tabakprodukte herstellen, kann jedoch in Unternehmen investieren, die indirekt höchstens 5 % ihrer Umsätze mit Tabak erwirtschaften. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Fondsportfolios an, um zu erreichen, dass das ESG-Rating des Portfolios beständig höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Stammaktien von US-Unternehmen, die an regulierten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts aufgeführt, und bei denen der Anlageverwalter davon ausgeht, dass sie ihre Erträge und/oder ihren Cashflow derzeit steigern oder potenziell steigern können, deren durchschnittliche Steigerungsrate bei Erträgen und/oder Cashflow über derjenigen von Unternehmen liegt, deren Wertpapiere im Standard & Poor's Daily Price Index of 500 Common Stocks („S&P 500 Index“) enthalten sind. Der Anlageverwalter konzentriert seine Titelauswahl für den Fonds auf die diversifizierte Gruppe junger Wachstumsunternehmen, die ihre „Startup“-Phase eventuell hinter sich gelassen haben und in den zwei oder drei Jahren nach Erwerb ihrer Aktien durch den Fonds positive Erträge sowie die Aussicht auf das Erreichen deutlicher Gewinnsteigerungen aufweisen. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozess an, um das ESG-Profil eines Unternehmens zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings anhand seines ESG-Ratingsystems mit quantitativer und qualitativer Beurteilung. Dieses System hat vier Bewertungsstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B, die den Unternehmen basierend auf ihrer Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen werden. Unternehmen mit einem B-Rating im proprietären ESG-Ratingsystem werden für eine Anlage im Fonds nicht berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit erheblicher Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und im Bergbau, die nach Ansicht von Analysten keine eindeutig besseren ESG-Merkmale aufweisen als andere ähnliche Unternehmen, und
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind.

Der Fonds ist nicht in Unternehmen engagiert, die Tabak und Tabakprodukte herstellen, kann jedoch in Unternehmen investieren, die indirekt höchstens 5 % ihrer Umsätze mit Tabak erwirtschaften. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Fondsportfolios an, um zu erreichen, dass das ESG-Rating des Portfolios beständig höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlageziel – Erzielung hoher Erträge. Langfristiger Kapitalzuwachs ist ein sekundäres Ziel.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die voraussichtlich Anlageerträge, Dividendenzahlungen oder andere Ausschüttungen bringen und die an den in Anhang III des Prospekts aufgeführten geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Emittenten aus aller Welt begeben werden. Der Fonds kann in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere von Emittenten mit beliebiger Marktkapitalisierung investieren. Bei der Auswahl der Wertpapiere wendet der Anlageverwalter einen kombinierten fundamentalen und makroökonomischen Ansatz an, um Anlagewerte zu finden, die attraktive Dividenden und zukünftige Ertragsaussichten bieten. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds ist bestrebt, langfristig in Unternehmen zu investieren, die er für qualitativ hochwertig hält und die über nachhaltige Wettbewerbsvorteile verfügen, welche sich in hohen Kapitalrenditen, starken Bilanzen und kompetenten Managementteams zeigen, die das Kapital effizient einsetzen. Der Fonds wird nicht in Unternehmen investieren, die in erheblichem Maße direkt an der Gewinnung fossiler Brennstoffe und dem Bergbau beteiligt sind, sondern stattdessen nach anderen attraktiven nachhaltigen Möglichkeiten in den Bereichen Energie, Industrie und Grundstoffe suchen.

Wenngleich die Vermögenswerte des Fonds normalerweise hauptsächlich in Stammaktien von US-Unternehmen investiert werden, kann der Fonds insgesamt bis zu 15 % seines Nettoinventarwerts in wandelbare Wertpapiere (die eingebettete Derivate und/oder Leverage enthalten können), Vorzugsaktien, Optionsscheine, REITs, Rule-144A-Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an geregelten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden, investieren. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens 85 % seines Nettoinventarwerts in US-Beteiligungspapiere (einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien), die an geregelten Märkten in den Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Verkaufsprospekts der Gesellschaft dargelegt, und die von Unternehmen begeben werden, die die Finanzkriterien des Anlageverwalters und seine Kriterien für ESG-Richtlinien erfüllen („Sustainability Leader“). Der Anlageverwalter wendet seine ESG Sustainability Leader-Kriterien auf 100 % des Fondsportfolios an. Beim Portfolioaufbau verkleinert der Anlageverwalter das Anlageuniversum des Fonds um mindestens 20 %, damit nur Unternehmen aufgenommen werden, die Sustainability Leader sind.

Der Anlageverwalter ermittelt anhand eines etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozesses, ob ein Unternehmen ein Sustainability Leader ist. Dieser eigene Prozess des Anlageverwalters umfasst die Erstellung eines ESG-Ratingsystems, das auf der langjährigen Erfahrung des Anlageverwalters bei der Verwaltung von ESG-Anlagestrategien und der Ermittlung von Best Practices im Bereich ESG basiert. Die führende Rolle im Bereich der Nachhaltigkeit kann sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet werden, und zwar durch das ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. Das ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters besteht aus vier Bewertungstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B, die den Unternehmen basierend auf ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen werden.

Der Fonds besitzt keine Anteile von Produzenten fossiler Brennstoffe, von Herstellern umstrittener Waffen (d. h. Antipersonenminen, Kernwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition) und von Unternehmen, die 5 % oder mehr ihres Umsatzes aus Tabak oder mehr als 5 % ihres Umsatzes aus konventionellen Waffen oder 15 % ihres Umsatzes aus Kernkrafterzeugung erzielen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere, die an geregelten Märkten auf der ganzen Welt, einschließlich Schwellenländern, notiert sind oder gehandelt werden und wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Bis zu 25 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Beteiligungstitel von Emittenten in Schwellenländern investiert werden. Das Engagement des Fonds in russischen Wertpapieren wird 15 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht übersteigen. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Vorschrift 68(1)(e) der OGAW-Vorschriften investieren, und diese Anlagen müssen dem Zweck dienen, ein Engagement in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten zu bieten oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Bis zu 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds können in Optionsscheine investiert werden. Der Fonds kann Liquiditätspositionen halten oder in Geldmarktinstrumente investieren, um Kapitalströme zu managen.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter wendet einen etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozess an, um das ESG-Profil eines Unternehmens zu bestimmen. Dazu gehört die Erstellung eines ESG-Ratings anhand seines ESG-Ratingsystems mit quantitativer und qualitativer Beurteilung. Dieses System hat vier Bewertungstufen: Die Ratings AAA, AA, A und B, die den Unternehmen basierend auf ihrer Leistung in wichtigen ESG-Bereichen zugewiesen werden. Unternehmen mit einem B-Rating im proprietären ESG-Ratingsystem werden für eine Anlage im Fonds nicht berücksichtigt.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen mit maßgeblicher Beteiligung an der Gewinnung und/oder Produktion fossiler Brennstoffe und im Bergbau,
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind, und in
- Unternehmen, die 15 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Kernkrafterzeugung erzielen.

Der Fonds ist nicht in Unternehmen engagiert, die Tabak und Tabakprodukte herstellen, kann jedoch in Unternehmen investieren, die indirekt höchstens 5 % ihrer Umsätze mit Tabak erwirtschaften. Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben dargelegt) auf 100 % des Fondsportfolios an, um zu erreichen, dass das ESG-Rating des Portfolios beständig höher ist als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen stabilen Wachstums aus regelmäßigen und kontinuierlichen Erträgen aus Dividenden und Zinsen sowie Kapitalzuwachs aus einem Portfolio globaler Infrastrukturtitel.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an geregelten Märkten in den G7-Ländern USA, Großbritannien, Japan, Deutschland, Frankreich, Italien und Kanada notiert sind oder gehandelt werden Kanada sowie Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an geregelten Märkten anderer Industrie- und Schwellenländer, einschließlich Indien, notiert sind oder gehandelt werden. Zu den Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren, in die der Fonds investieren darf, gehören Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Bezugsrechte, Optionsscheine und Genusscheine von Infrastrukturunternehmen. Der Fonds kann in American und Global Depositary Receipts (ADRs/GDRs) von Unternehmen investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt.

Der Fonds kann bis zu 20 Prozent seines Nettoinventarwerts in geschlossene Organismen für gemeinsame Anlagen wie REITs investieren. Jeder REIT, in den der Fonds investiert, muss an einem geregelten Markt notiert sein oder gehandelt werden. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren, sofern die Anlagepolitik und die Liquiditätsvorschriften dieser Organismen für gemeinsame Anlagen mit denen des Fonds übereinstimmen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Für diesen Fonds werden ESG-Risiken und -Chancen soweit möglich auf zwei Arten berücksichtigt. Erstens bei der Bewertung der vom Anlageverwalter prognostizierten Cashflows in Bezug auf geeignete Portfoliounternehmen im Rahmen einer fundamentalen Wertpapierbewertung. Zweitens: Wenn die ESG-Faktoren nicht in diesen prognostizierten Cashflows erfasst werden können, werden sie stattdessen durch eine Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate der Anlage erfasst. Unter diesen Umständen werden die relevanten ESG-Faktoren und das Management dieser Faktoren durch das Unternehmen über eine proprietäre Scorecard durch den betreffenden Analysten bewertet, was wiederum zu einer Anpassung der erforderlichen Rendite, der so genannten Hurdle Rate, führt, die auf jede potenzielle Investition angewandt wird.

Aufgrund des integrierten ESG-Ansatzes wendet der Anlageverwalter seinen ESG-Prozess bei mindestens 90 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Im Einklang mit dem Bewertungsansatz des Fonds, der eine Haltedauer von fünf Jahren voraussetzt, wird die Nachhaltigkeit anhand eines ESG-Score eingestuft – sowohl zum aktuellen Zeitpunkt auf der Grundlage laufender Prozesse, Leitlinien und des aktuellen Verhaltens, als auch im Hinblick auf einen erwarteten ESG-Score in fünf Jahren auf der Grundlage der Managementziele und -leitlinien. So kann das Team Unternehmen identifizieren, deren Nachhaltigkeitspraktiken sich voraussichtlich verbessern werden.

Die ESG-Scores der Unternehmen werden auf relativer Basis verglichen. Bei Unternehmen im obersten Quartil wird die erforderliche Rendite, die so genannte Hurdle Rate, auf einer gleitenden Skala reduziert. Die unteren drei Quartile, basierend auf den ESG-Scores, werden durch eine Erhöhung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate auf einer gleitenden Skala bestraft.

Rund 600 Unternehmen werden hinsichtlich Liquidität, Infrastrukturengagement und Infrastrukturqualität bewertet. Sobald dieses Universum durch die Liquiditätsanalyse um etwa 50 % reduziert wurde, werden etwa 10 % der verbleibenden Unternehmen mit geringem Infrastrukturengagement ausgeschlossen, wobei Unternehmen mit nicht akzeptabler Beteiligung an Nicht-Infrastrukturaktivitäten ausgeschlossen werden. Weitere 20 % der Unternehmen werden aufgrund mangelnder Infrastrukturqualität ausgeschlossen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die einen Großteil ihres Umsatzes aus der Gewinnung oder Produktion fossiler Brennstoffe erzielen,
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind, und in
- Unternehmen, deren Umsatzerlöse zu mindestens 5 % aus Tabakwaren stammen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] (Handel eingestellt am 17. November 2022)

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen stabilen Wachstums aus regelmäßigen und kontinuierlichen Erträgen aus Dividenden und Zinsen sowie Kapitalzuwachs aus einem Portfolio von Schwellenländer-Infrastrukturtiteln.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und von Unternehmen begeben werden, die mindestens 50 % ihres Gewinns vor Zinsen, Steuern und Abschreibung in Schwellenländern, einschließlich Indien, erzielen. Es ist beabsichtigt, dass kein einzelnes Schwellenland mehr als 40 % des Nettoinventarwerts des Fonds ausmachen darf. Zu den Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren, in die der Fonds investieren darf, gehören Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Bezugsrechte, Optionsscheine und Genusscheine von Infrastrukturunternehmen.

Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere investieren, die an russischen Märkten gehandelt werden. Anlagen in Wertpapiere, die an russischen Märkten gehandelt werden, erfolgen nur in Beteiligungspapiere, die an der Moskauer Börse notiert sind und/oder gehandelt werden. Der Fonds kann in amerikanische, internationale und globale Hinterlegungsscheine (ADRs/GDRs) von Unternehmen investieren, die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in geschlossene Organismen für gemeinsame Anlagen wie REITs investieren, sofern die Anlagepolitik mit der des Fonds übereinstimmt. Alle REITs, in die der Fonds investieren wird, müssen an einem geregelten Markt notiert sein oder gehandelt werden. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren, sofern die Anlagepolitik und die Liquiditätsvorschriften dieser Organismen für gemeinsame Anlagen mit denen des Fonds übereinstimmen.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlageziel – Erzielung von Erträgen bestehend aus Dividenden und Zinsen bei gleichzeitiger Erzielung eines langfristigen Kapitalwachstums.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Infrastrukturunternehmen über Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an geregelten Märkten in den G7-Ländern USA, Großbritannien, Japan, Deutschland, Frankreich, Italien und Kanada notiert sind oder gehandelt werden Kanada sowie Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die an geregelten Märkten anderer Industrie- und Schwellenländer notiert sind oder gehandelt werden (letztere bis zu 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds). Zu den Aktien und aktienähnlichen Wertpapieren, in die der Fonds investieren darf, gehören Stammaktien, Vorzugsaktien, Hinterlegungsscheine, Bezugsrechte, Optionsscheine und Genusscheine von Infrastrukturunternehmen. Genusscheine werden in der Regel nur dann eingesetzt, wenn der direkte Zugang zu Aktien in einem bestimmten Markt eingeschränkt ist oder sich verzögert, was beispielsweise in Indien der Fall sein kann.

Der Fonds kann bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts in REITs investieren. Jeder REIT, in den der Fonds investiert, muss an einem geregelten Markt notiert sein oder gehandelt werden. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile anderer offener OGAW oder anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investieren, sofern die Anlagepolitik und die Liquiditätsvorschriften dieser Organismen für gemeinsame Anlagen mit denen des Fonds übereinstimmen.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Für diesen Fonds werden ESG-Risiken und -Chancen soweit möglich auf zwei Arten berücksichtigt. Erstens bei der Bewertung der vom Anlageverwalter prognostizierten Cashflows in Bezug auf geeignete Portfoliounternehmen im Rahmen einer fundamentalen Wertpapierbewertung. Zweitens: Wenn die ESG-Faktoren nicht in diesen prognostizierten Cashflows erfasst werden können, werden sie stattdessen durch eine Anpassung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate der Anlage erfasst. Unter diesen Umständen werden die relevanten ESG-Faktoren und das Management dieser Faktoren durch das Unternehmen über eine proprietäre Scorecard durch den betreffenden Analysten bewertet, was wiederum zu einer Anpassung der erforderlichen Rendite, der so genannten Hurdle Rate, führt, die auf jede potenzielle Investition angewandt wird.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess auf mindestens 90 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds. Im Einklang mit dem Bewertungsansatz des Fonds, der eine Haltedauer von fünf Jahren voraussetzt, wird die Nachhaltigkeit anhand eines ESG-Score eingestuft – sowohl zum aktuellen Zeitpunkt auf der Grundlage laufender Prozesse, Leitlinien und des aktuellen Verhaltens, als auch im Hinblick auf einen erwarteten ESG-Score in fünf Jahren auf der Grundlage der Managementziele und -leitlinien. So kann das Team Unternehmen identifizieren, deren Nachhaltigkeitspraktiken sich voraussichtlich verbessern werden.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)

Die ESG-Scores der Unternehmen werden auf relativer Basis verglichen. Bei Unternehmen im obersten Quartil wird die erforderliche Rendite, die so genannte Hurdle Rate, auf einer gleitenden Skala reduziert. Die unteren drei Quartile, basierend auf den ESG-Scores, werden durch eine Erhöhung der erforderlichen Rendite oder Hurdle Rate auf einer gleitenden Skala bestraft.

Rund 600 Unternehmen werden hinsichtlich Liquidität, Infrastrukturengagement und Infrastrukturqualität bewertet. Sobald dieses Universum durch die Liquiditätsanalyse um etwa 50 % reduziert wurde, werden etwa 10 % der verbleibenden Unternehmen mit geringem Infrastrukturengagement ausgeschlossen, wobei Unternehmen mit nicht akzeptabler Beteiligung an Nicht-Infrastrukturaktivitäten ausgeschlossen werden. Weitere 20 % der Unternehmen werden aufgrund mangelnder Infrastrukturqualität ausgeschlossen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus der Gewinnung oder Produktion fossiler Brennstoffe erzielen,
- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von Waffen erzielen, sowie in Unternehmen, die Umsätze mit (a) verbotenen Waffen im Sinne (i) des Übereinkommens über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) des Übereinkommens über Streumunition und b) Waffen erzielen, die als B- oder C-Waffen gemäß der UN-Biowaffenkonvention bzw. der UN-Chemiewaffenkonvention klassifiziert sind, und in
- Unternehmen, deren Umsatzerlöse zu mindestens 5 % aus Tabakwaren stammen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in ein diversifiziertes Portfolio aus Beteiligungspapieren von US-Small-Caps (d. h. US-Unternehmen mit einer Marktkapitalisierung von weniger als 3 Mrd. US-Dollar), die an geregelten Märkten in den USA notiert sind oder gehandelt werden. Der Anlageverwalter legt das Vermögen des Fonds in diesen Unternehmen an, um seiner Meinung nach günstige Situationen für unterbewertete Wertpapiere opportunistisch auszunutzen. Zu solchen günstigen Situationen können Turnarounds, aufstrebende Wachstumsunternehmen mit unterbrochenen Ertragsmustern, Unternehmen mit verkannten Vermögenswerten oder unterbewertete Wachstumsunternehmen gehören. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Der Anlageverwalter wendet bei der Verwaltung des Fondsvermögens eine Value-Methode an.

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Beteiligungswerte von US-Unternehmen mit einer Börsenkapitalisierung von weniger als 5 Mrd. US-Dollar (gemessen zum Zeitpunkt der Anlage), die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Bis zu einem Drittel des Nettoinventarwerts des Fonds kann investiert werden in (i) Beteiligungspapiere (einschließlich Stammaktien, Vorzugsaktien und wandelbare Wertpapiere) von Unternehmen mit einer Börsenkapitalisierung von mehr als 5 Mrd. US-Dollar, gemessen zum Zeitpunkt der Investition, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden, (ii) Schuldtitel, die von nationalen Regierungen und ihren Gebietskörperschaften oder Behörden begeben oder garantiert werden, (iii) Unternehmensschuldtitel von Emittenten, die ihren Sitz an geregelten Märkten haben oder deren Wertpapiere dort notiert sind oder gehandelt werden, und (iv) Liquidität für eine effiziente Portfolioverwaltung. Nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds, gemessen zum Zeitpunkt der Anlage, werden in Wertpapiere von Emittenten investiert, die an geregelten Märkten außerhalb der Vereinigten Staaten notiert sind oder gehandelt werden. Darüber hinaus dürfen nicht mehr als 5 % des Nettoinventarwerts des Fonds in Schuldtitel investiert werden, deren Rating zum Zeitpunkt des Kaufs unter „Investment Grade“ liegt. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlageziel – Erzielung von langfristigem Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Small-Cap-Unternehmen mit Hauptsitz in Ländern weltweit, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Als Small-Cap-Unternehmen gelten für den Anlageverwalter solche, deren Börsenkapitalisierung nicht höher ist als die des größten Unternehmens im MSCI ACWI Small-Cap Index (der „Benchmark“) zum Zeitpunkt seiner letzten Neuzusammenstellung. Der Anlageverwalter verfolgt eine Anlagestrategie, die sich auf Unternehmen konzentriert, die seiner Meinung nach über Wettbewerbsvorteile verfügen und anhaltend hohe Renditen auf das investierte Kapital bieten, von denen er glaubt, dass sie den Wert dieser Unternehmen im Laufe der Zeit steigern werden. Darüber hinaus sucht der Anlageverwalter nach Unternehmen, die seiner Meinung nach ein attraktives Finanzprofil aufweisen, darunter Unternehmen mit: (i) konservativen Bilanzen, (ii) umsichtiger Kapitalallokation und (iii) attraktiven Wiederanlagemöglichkeiten.

Der Fonds investiert maximal 60 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen mit Hauptsitz in den Vereinigten Staaten. Unter normalen Marktbedingungen wird der Fonds mindestens 40 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen investieren, die ihren Hauptsitz in mindestens drei verschiedenen Ländern außerhalb der Vereinigten Staaten haben. Der Fonds kann auch bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in Unternehmen investieren, die ihren Hauptsitz in Schwellenländern haben.

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] (Handel eingestellt am 11. Juli 2022)

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert zu jeder Zeit mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere von Unternehmen, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden und ihren Sitz in Europa haben oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Europa ausüben, unter anderem in Österreich, Belgien, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Griechenland, Ungarn, Irland, Italien, den Niederlanden, Norwegen, Polen, Portugal, Spanien, Schweden, der Schweiz und dem Vereinigten Königreich, vorbehaltlich der geltenden Beschränkungen für Investitionen durch ausländische Investoren. Der Fonds versucht, sein Anlageziel zu erreichen, indem er hauptsächlich in Wertpapiere von Unternehmen investiert, von denen angenommen wird, dass sie attraktive Möglichkeiten für langfristigen Kapitalzuwachs bieten. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens zwei Drittel seines Nettoinventarwerts in an geregelten Märkten notierte oder gehandelte Beteiligungspapiere von Unternehmen, die ihren Sitz in einem oder mehreren der folgenden asiatischen Schwellenländer haben oder dort den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit ausüben, vorbehaltlich der von diesen Ländern auferlegten Beschränkungen für Investitionen durch ausländische Investoren: China, Hongkong, Indonesien, Malaysia, die Philippinen, Singapur, Südkorea, Taiwan, Indien, Thailand, Australien und Neuseeland. Darüber hinaus kann der Fonds von Zeit zu Zeit auch in Beteiligungspapiere von Unternehmen mit Sitz in Pakistan und Sri Lanka investieren. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in aktiengebundene oder strukturierte Schuldverschreibungen investiert werden, bei denen es sich um übertragbare Wertpapiere handelt, deren zugrunde liegendes Engagement in Beteiligungspapieren bestehen kann.

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] (Handel eingestellt am 27. April 2022)

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert jederzeit mindestens 70 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere (einschließlich Stammaktien und Vorzugsaktien) von Unternehmen, die ihren Sitz an einem geregelten Markt in einem beliebigen Land der Welt haben und dort notiert sind oder gehandelt werden. Damit der Fonds sein Anlageziel erreicht, wird der Anlageverwalter hauptsächlich in Unternehmen investieren, die in Industrieländern ansässig und börsennotiert sind, und er wird versuchen, in

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] (Handel eingestellt am 27. April 2022) – (Fortsetzung)

Unternehmen zu investieren, die in Industrie- und Schwellenländern ansässig sind und in unterschiedlichen Branchen tätig sind. Obwohl es keine Beschränkungen hinsichtlich der Kapitalisierung gibt, wird der Fonds versuchen, hauptsächlich in Unternehmen mit hoher Marktkapitalisierung zu investieren. Bis zu 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds dürfen in Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations investiert werden.

Durch den Einsatz von Derivaten kann der Nettoinventarwert des Fonds bis zu 100 % gehebelt sein (berechnet nach dem Commitment-Ansatz). Das maximale Engagement des Fonds in Total Return Swaps, basierend auf dem Nominalwert dieser Instrumente, beträgt 20 % seines Nettoinventarwerts.

Der Fonds kann über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“) in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien investieren. Das Engagement in chinesischen A-Aktien über die Stock Connects wird nicht mehr als 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds betragen. Der Fonds kann zudem ein indirektes Engagement in chinesischen A-Aktien aufbauen. Das Gesamtengagement in russischen Wertpapieren und chinesischen A-Aktien wird 15 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds nicht übersteigen.

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

Anlageziel – Partizipation am Wachstum des asiatischen Bruttoinlandsprodukts („BIP“) und Erzielung eines attraktiven Risiko-/Renditeprofils in einem historisch volatilen Markt mithilfe einer Long-Only-Aktienstrategie.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Aktien, sei es direkt oder indirekt über aktienähnliche Wertpapiere oder Longpositionen in Derivaten auf Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, die (i) an geregelten Märkten in Festlandchina, Hongkong, Indien, Indonesien, Malaysia, den Philippinen, Singapur, Südkorea, Taiwan und Thailand (zusammen die „Primärländer“) notiert sind oder gehandelt werden oder (ii) an geregelten Märkten in anderen Ländern als den Primärländern notiert sind oder gehandelt werden, jedoch von Unternehmen begeben werden, die ihre Haupttätigkeit in den Primärländern ausüben oder die den Großteil ihrer Geschäftsgewinne in diesen Ländern erzielen. Der Fonds kann in chinesische Aktien (d. h. Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in China haben oder den überwiegenden Teil ihrer Umsätze in China erzielen) investieren, auch in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Es gibt keine Beschränkung für das maximale Gesamtengagement in chinesischen Aktien, auch nicht über die Stock Connects.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts investieren in: Geldmarktinstrumente, Einlagen, Derivate und Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile dieser anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Der Fonds geht keine Shortpositionen ein.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, künftig nachhaltige Renditen zu erzielen. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch das eigene ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. In den proprietären ESG-Ratings spiegeln sich zukunftsgerichtete Analysen wider. Dabei wird den Unternehmen jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (Umwelt und Soziales) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) unter Berücksichtigung von ökologischen, sozialen und Governance-bezogenen Nachhaltigkeitsfaktoren zugewiesen. Unternehmen mit einem Nachhaltigkeitsrisiko-Rating von 4 oder höher werden nicht in den Fonds aufgenommen. Unternehmen mit einem Nachhaltigkeitsrisiko-Rating von 4 oder höher werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Herstellung von Tabakwaren erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der direkten Beteiligung an der Gewinnung fossiler Brennstoffe erzielen,
- Unternehmen, die Umsatz mit dem Abbau von Metallen und Mineralien gemäß der GICS-Branchenklassifikation „Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien“ erzielen,
- Unternehmen, die an der Herstellung, dem Verkauf oder dem Vertrieb von speziellen und wichtigen Bestandteilen von Antipersonenminen und Streumunition beteiligt sind, und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben beschrieben) auf 100 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Anlageverwalter geht davon aus, dass das Fondsportfolio typischerweise aus 20 bis 40 verschiedenen Emittenten besteht, wenngleich der Fonds unter bestimmten Umständen weniger als 20 Emittenten oder mehr als 40 Emittenten halten kann.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

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

Anlageziel – Erzielung von langfristigem Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettovermögens in Aktien, entweder direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere oder Long-Positionen in Finanzderivaten auf Aktien und aktienbezogene Wertpapiere, die an geregelten Märkten weltweit (auch in Schwellenländern) notiert sind oder gehandelt werden, wie in Anhang III des Prospekts dargelegt. Der Anlageverwalter interessiert sich vor allem für Unternehmen: (1) von denen er glaubt, dass sie das Potenzial haben, eine hohe Rendite auf das investierte Kapital zu erwirtschaften und/oder aufrechtzuerhalten, die über ihren gewichteten durchschnittlichen Kapitalkosten liegt, (2)(1) bei denen der Firmenwert keinen dominierenden Vermögenswert in der Bilanz darstellt und (3)(1) bei denen der Streubesitz mehr als 3 Mrd. USD beträgt.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts investieren in: Geldmarktinstrumente, Einlagen und Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile dieser anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Der Fonds kann in chinesische Aktien (d. h. Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in China haben oder den überwiegenden Teil ihrer Umsätze in China erzielen) investieren, auch in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das indirekte Engagement in chinesischen A-Aktien ist auf 10 % des Nettoinventarwerts des Fonds beschränkt. Es gibt keine Beschränkung für das maximale Gesamtengagement in chinesischen Aktien, auch nicht über die Stock Connects.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, künftig nachhaltige Renditen zu erzielen. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch das eigene ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. In den proprietären ESG-Ratings spiegeln sich zukunftsgerichtete Analysen wider. Dabei wird den Unternehmen jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (Umwelt und Soziales) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) unter Berücksichtigung von ökologischen, sozialen und Governance-bezogenen Nachhaltigkeitsfaktoren zugewiesen. Unternehmen mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risiko-Rating von 4 oder höher werden nicht in den Fonds aufgenommen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^A – (Fortsetzung)

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung, dem Vertrieb oder dem Großhandel von Tabakwaren erzielen,
- Unternehmen, die Umsätze mit der Herstellung oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition),
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung oder dem Vertrieb von konventionellen Waffen erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Gewinnung fossiler Brennstoffe erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Kohleverstromung oder dem Abbau oder Vertrieb von Kraftwerkskohle erzielen,
- Unternehmen, die Umsatz mit dem Abbau von Metallen und Mineralien gemäß der GICS-Branchenklassifikation „Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien“ erzielen,
- Unternehmen, die 15 % oder mehr ihres Umsatzes aus der Kernkraftzeugung erzielen, und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben beschrieben) auf 100 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Anlageziel – Erzielung von Erträgen. Langfristiger Kapitalzuwachs ist ein sekundäres Ziel.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere und aktienähnliche Wertpapiere (einschließlich Vorzugsaktien, australische Trusts und Stapled Securities, REITs, Hinterlegungsscheine und Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Beteiligungspapiere), die (i) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Prospekts dargelegt) in der Region Asien-Pazifik (ohne Japan) notiert sind oder gehandelt werden, wozu auch die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertretenen Länder gehören, oder (ii) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Prospekts dargelegt) außerhalb der Region Asien-Pazifik (ohne Japan) notiert sind oder gehandelt werden, aber von Unternehmen begeben werden, deren Haupttätigkeit in Ländern erfolgt, die im MSCI AC Asia Pacific ex Japan Index vertreten sind. Dieser Index besteht derzeit aus etwa 1.200 Unternehmen mit großer und mittlerer Marktkapitalisierung aus 13 Ländern im asiatisch-pazifischen Raum (ohne Japan). Der Index umfasst derzeit vier Industrieländer und neun Schwellenländer, sodass der Fonds möglicherweise erheblich in Wertpapieren aus Schwellenländern engagiert ist. Die Strategie des Anlageverwalters konzentriert sich auf Emittenten aus drei Hauptsektoren: (1) REITs, wie Einkaufszentren, Bürogebäude und Industriegebäude, (2) Infrastruktur wie Mautstraßen, Schifffahrtshäfen, Flughäfen und Eisenbahnen und (3) Versorgungseinrichtungen wie Gas- und Stromnetze und Generatoren. Der Fonds kann von Zeit zu Zeit in Vorzugsaktien investieren, wenn der Anlageverwalter der Ansicht ist, dass diese Wertpapiere eine attraktive Renditechance bieten und gleichzeitig mit dem Anlageziel des Fonds übereinstimmen. Der in solche Anlagewerte investierte Gesamtbetrag beträgt höchstens 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Der Fonds darf insgesamt maximal 50 % seines Nettoinventarwerts in Beteiligungspapiere und aktienbezogene Wertpapiere investieren (einschließlich Vorzugsaktien, australische Trusts und Stapled Securities, REITs und Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Beteiligungspapiere), die (i) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Prospekts dargelegt) in Australien oder Neuseeland notiert sind oder gehandelt werden oder (ii) an geregelten Märkten (wie in Anhang III des Prospekts dargelegt) außerhalb Australiens und Neuseelands notiert sind oder gehandelt werden, aber von Unternehmen begeben werden, deren Hauptgeschäftstätigkeit in Australien oder Neuseeland ausgeübt wird. Der Fonds darf insgesamt bis zu 60 % seines Nettoinventarwerts in REITs und immobilienbezogene Wertpapiere (Aktien und aktienähnliche Wertpapiere (einschließlich Vorzugsaktien, australische Trusts und Stapled Securities sowie Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis auf Beteiligungspapiere) von Immobilienunternehmen investieren, die in MSCI Global Industry Classification Standard (GICS) Industry Group 6010 – Real Estate enthalten sind). Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts investieren in: Geldmarktinstrumente, Einlagen, Derivate und Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Investitionen in solche Organismen erfolgen zu dem Zweck, ein Engagement in den hierin beschriebenen Arten von Instrumenten aufzubauen und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds kann in chinesische Aktien (d. h. Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in China haben oder den überwiegenden Teil ihrer Umsätze in China erzielen) investieren, auch in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das maximale Gesamtengagement des Fonds in chinesischen Aktien, auch über die Stock Connects, beträgt 75 % des Nettoinventarwerts des Fonds.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren/-Merkmale. Diese Faktoren/Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch dessen eigenes ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. Der Anlageverwalter bewertet diese ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, künftig nachhaltige Renditen zu erzielen. In den proprietären ESG-Ratings spiegeln sich zukunftsgerichtete Analysen wider. Dabei wird den Unternehmen jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (Umwelt und Soziales) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) unter Berücksichtigung von ökologischen, sozialen und Governance-bezogenen Nachhaltigkeitsfaktoren zugewiesen. Unternehmen mit einem Nachhaltigkeitsrisiko-Rating von 5 werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Herstellung von Tabakwaren erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Herstellung von Waffen erzielen,
- Unternehmen, die der GICS-Branchenklassifizierung „Erdöl, Erdgas und nicht erneuerbare Brennstoffe“ angehören,
- Unternehmen, die an der Herstellung, dem Verkauf oder dem Vertrieb von speziellen und wichtigen Bestandteilen von Antipersonenminen und Streumunition beteiligt sind, und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben beschrieben) auf 100 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^A

Anlageziel – Erzielung von langfristigem Kapitalzuwachs.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettovermögens in Aktienwerte (einschließlich Optionsscheine), die an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, wenn der Emittent der Aktie seinen Sitz in einem Land hat, das im MSCI Emerging Markets Index enthalten ist, oder den überwiegenden Teil seiner Einnahmen aus einem Land bezieht, das im MSCI Emerging Markets Index enthalten ist, oder wenn der geregelte Markt, an dem die Aktie notiert ist oder gehandelt wird, in einem Land liegt, das im MSCI Emerging Markets Index enthalten ist. Der MSCI Emerging Markets Index umfasst Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung aus über 20 Schwellenländern und wird halbjährlich neu gewichtet. Die Anlagen des Fonds in Aktien können direkt oder indirekt über aktienbezogene Wertpapiere (einschließlich amerikanischer Einlagenzertifikate (ADRs) und globaler Einlagenzertifikate (GDRs) oder Long-Positionen in Derivaten auf Aktien und aktienbezogene Wertpapiere erfolgen. Anlagen in ADRs und GDRs dürfen 15 % des Nettoinventarwerts des Fonds nicht überschreiten.

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] – (Fortsetzung)

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts investieren in: Geldmarktinstrumente, Einlagen und Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile dieser anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf.

Der Fonds kann in chinesische Aktien (d. h. Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren Sitz in China haben oder den überwiegenden Teil ihrer Umsätze in China erzielen) investieren, auch in bestimmte zulässige chinesische A-Aktien über Shanghai-Hong Kong Stock Connect und/oder Shenzhen-Hong Kong Stock Connect (die „Stock Connects“). Das maximale Engagement in chinesischen Aktien, auch über die Stock Connects, entspricht dem Umfang, in dem chinesische Aktien im MSCI Emerging Markets Index vertreten sind, zuzüglich 10 %.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren/-Merkmale. Diese Faktoren/Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch dessen eigenes ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. Der Anlageverwalter bewertet diese ESG-Faktoren, die sich auf die Fähigkeit eines Emittenten auswirken könnten, künftig nachhaltige Renditen zu erzielen. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch das eigene ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess. In den proprietären ESG-Ratings spiegeln sich zukunftsgerichtete Analysen wider. Dabei wird den Unternehmen jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (Umwelt und Soziales) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) unter Berücksichtigung von ökologischen, sozialen und Governance-bezogenen Nachhaltigkeitsfaktoren zugewiesen. Unternehmen mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risiko-Rating von 4 oder höher werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung, dem Vertrieb oder dem Großhandel von Tabakwaren erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung oder dem Vertrieb von Waffen erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Kohleverstromung oder dem Abbau oder Vertrieb von Kraftwerkskohle erzielen,
- Unternehmen, die an der Produktion, dem Verkauf oder dem Vertrieb von speziellen und wichtigen Komponenten umstrittener Waffen (d. h. Antipersonenminen, biologische und chemische Waffen und Streumunition) beteiligt sind, und
- Unternehmen, die im Rahmen des UN Global Compact als „fail“ eingestuft wurden.

Der Anlageverwalter wendet seinen ESG-Prozess (wie oben beschrieben) auf 100 % des Fondsportfolios an. Das ESG-Rating des Fondsportfolios ist beständig höher als das des Anlageuniversums des Fonds.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]

Anlageziel – Erzielung eines langfristigen Kapitalzuwachses durch Investitionen in ein konzentriertes Portfolio, das hauptsächlich aus europäischen Aktien besteht.

Anlagepolitik – Der Fonds investiert mindestens 80 % seines Nettoinventarwerts in Aktien von Unternehmen, die ihren Sitz in Europa haben oder dort notiert sind oder den überwiegenden Teil ihrer Geschäftstätigkeit in Europa ausüben. Solche Investitionen können direkt oder indirekt über aktienähnliche Wertpapiere, Hinterlegungsscheine oder Organismen für gemeinsame Anlagen oder Longpositionen über Derivate erfolgen. Der Fonds wird in Unternehmen investieren, die nach Ansicht des Anlageverwalters gemäß dem Anlageprozess des Anlageverwalters (i) das Potenzial haben, eine hohe Rendite auf das investierte Kapital (ROIC) zu erwirtschaften oder aufrechtzuerhalten, die über ihren gewichteten durchschnittlichen Kapitalkosten liegt, (ii) das Potenzial haben, langfristig ein attraktives Wachstumsprofil zu bieten und/oder einen Cashflow zu generieren, und (iii) von denen erwartet wird, dass sie förderliche Rechnungslegungspraktiken und ESG-Praktiken anwenden. Der Fonds kann zur effizienten Portfolioverwaltung in Futures auf europäische Aktienindizes und zu Anlagezwecken in Optionsscheine mit niedrigem Ausübungspreis investieren, beispielsweise wenn der lokale Marktzugang über ein lokales Wertpapierdepot nicht möglich oder praktikabel ist. Devisenterminkontrakte dürfen nur in Bezug auf die vom Fonds angebotenen abgesicherten Anteilklassen eingesetzt werden. Der Fonds investiert nicht in andere Arten von Derivaten.

Der Fonds kann insgesamt bis zu 20 % seines Nettoinventarwerts investieren in: Geldmarktinstrumente, Einlagen, Derivate, außereuropäische Aktien und Anteile anderer Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, wobei der Fonds nicht mehr als 10 % seines Nettoinventarwerts in Anteile solcher anderen Organismen für gemeinsame Anlagen investieren darf. Investitionen in solche Organismen erfolgen zu dem Zweck, ein Engagement in europäischen Aktien aufzubauen oder anderweitig das Anlageziel und die Anlagepolitik des Fonds zu verfolgen. Der Fonds kann bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Wertpapiere investieren, die von russischen Emittenten begeben werden.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglicher Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der 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 der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

Der Anlageverwalter bewertet ESG-Faktoren/-Merkmale. Diese Merkmale werden sowohl quantitativ als auch qualitativ bewertet, und zwar durch das eigene ESG-Ratingsystem des Anlageverwalters und seinen direkten Research- und Engagement-Prozess.

Eine zusätzliche Berücksichtigung der ökologischen und sozialen Merkmale von Investitionen wird erreicht, indem die Investitionen auf Portfolioebene auf mögliche positive oder negative Risiken untersucht werden.

In den proprietären ESG-Ratings spiegeln sich zukunftsgerichtete Analysen wider. Dabei wird den Unternehmen jeweils eine Risikobewertung für Governance und Nachhaltigkeit (Umwelt und Soziales) von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko) unter Berücksichtigung von ökologischen, sozialen und Governance-bezogenen Nachhaltigkeitsfaktoren zugewiesen (wie im Abschnitt „Nachhaltigkeitsrisiko“ des Prospekts beschrieben). Unternehmen mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risiko-Rating von 4 oder höher werden nicht in den Fonds aufgenommen.

Darüber hinaus investiert der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung, dem Vertrieb oder dem Großhandel von Tabakwaren erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung oder dem Vertrieb von Waffen erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Herstellung oder dem Vertrieb fossiler Brennstoffe erzielen,
- Unternehmen, die mehr als 5 % ihres Umsatzes mit der Kohleverstromung oder dem Abbau oder Vertrieb von Kraftwerkskohle erzielen,
- Unternehmen, die umstrittene Waffen (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition) herstellen oder vertreiben,
- Unternehmen, die mehr als 15 % ihres Umsatzes aus der Kernkraftzeugung erzielen, und
- Unternehmen, die Umsatz mit dem Abbau von Metallen und Mineralien gemäß der GICS-Branchenklassifikation „Metalle und Bergbau, Kupfer, Gold und Edelmetalle und Mineralien“ erzielen.

Der Fonds hat die von ihm beworbenen ESG-Merkmale durch die Einrichtung der oben beschriebenen Prozesse erfüllt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Geänderter Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

Anlageziel – Erzielung von Erträgen bei gleichzeitigem Kapitalerhalt.

Anlagepolitik – Der Fonds wird in ein diversifiziertes Portfolio aus auf Euro lautenden festverzinslichen Schuldtiteln aus Industrie- und Schwellenländern investieren, das heißt frei übertragbare Schuldscheine, Schuldverschreibungen, fest- und variabel verzinsliche Anleihen, Nullkuponanleihen und nicht wandelbare Schuldverschreibungen (d. h. Schuldverschreibungen, die gegebenenfalls nicht in Beteiligungspapiere des jeweiligen Emittenten umgewandelt werden können), Credit-Linked Notes, Commercial Paper, Einlagenzertifikate und Bankakzepte, Pensionsgeschäfte mit Schuldtiteln als Basisinstrumenten (nur für Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung), STRIPS und inflationsindexierte Wertpapiere (d. h. Wertpapiere, die regelmäßig an die allgemeine Inflationsentwicklung im Emissionsland angepasst werden, siehe Abschnitt „Inflationsgeschützte Wertpapiere“ des Prospekts), auf Euro lautende Wertpapiere, die von staatlichen, quasi-staatlichen, supranationalen und Unternehmensemittenten begeben werden, die an geregelten Märkten notiert sind oder gehandelt werden. Zum Kaufzeitpunkt kann der Teilfonds bis zu 30 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtiteln, die durch Schwellenländer begeben wurden, anlegen. Die Schuldtitel, in die der Fonds investieren wird, werden überwiegend nicht wandelbar sein.

Die Strategie zielt darauf ab, über einen definierten Zeitraum Erträge zu erwirtschaften und gleichzeitig das Risiko einzelner Emittenten durch den Aufbau eines gut diversifizierten Portfolios zu minimieren. Die Auswahl der Wertpapiere erfolgt mit dem Ziel, ein umsichtiges Maß an Diversifizierung zwischen Sektoren und Emittenten sicherzustellen, bei denen der Anlageverwalter der Ansicht ist, dass die Fundamentaldaten attraktiv sind, das heißt insbesondere, dass die Wertpapiere attraktive Renditen im Verhältnis zur fundamentalen Einschätzung des Anlageverwalters zum zugrunde liegenden Schuldtitel und zum Gesamtniveau der Renditen am Markt aufweisen und ihre Kreditwürdigkeit als ausreichend erachtet wird, um davon ausgehen zu können, dass sie Erträge zahlen und bei Fälligkeit das Kapital zurückzahlen können. Der Fonds verfolgt sein Anlageziel und seine Anlagepolitik über einen Zeitraum von fünf Jahren nach Auflegung (das „Fälligkeitsdatum“).

Der Fonds wird mindestens 60 % seines Nettoinventarwerts in die in Absatz 2 aufgeführten Schuldtitel investieren, die von S&P besser als BBB-, von Moody's besser als Baa3 bzw. von Fitch besser als BBB- bewertet sind oder, falls sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter als von gleicher Qualität angesehen werden. Gleichzeitig wird ein durchschnittliches Kreditrating von „Investment Grade“ angestrebt. Der Fonds kauft nur Schuldtitel, die in Absatz 2 genannt sind und mindestens mit B- von S&P, B3 von Moody's bzw. B- von Fitch bewertet sind oder, wenn sie kein Rating haben, vom Anlageverwalter als gleichwertig eingeschätzt werden. Der Fonds darf bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in Schuldtitel anlegen, die ein Rating von B- durch S&P, B3 durch Moody's bzw. B- durch Fitch haben (einschließlich der entsprechenden Unterkategorien oder Abstufungen).

Der Fonds kann außerdem wandelbare Wertpapiere (ausgenommen bedingte wandelbare Wertpapiere) und andere Hybridanleihen bis zu einem Höchstwert von 10 % seines Nettoinventarwerts kaufen. Der Fonds kann in Geldmarktinstrumente investieren, darunter in Geldmarkt-OGAW oder zulässige Organismen für gemeinsame Anlagen im Sinne von Regulation 68(1)(e) der UCITS Regulations, sofern sie auf Euro lauten. Der Fonds kann auch in bestimmte Arten von Derivaten investieren, wie im Abschnitt „Anlagetechniken und -instrumente und Finanzderivate“ im Prospekt beschrieben, jedoch nur zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung.

Der Fonds fördert Umweltmerkmale und ist als Artikel-8-Fonds gemäß der Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) eingestuft.

Die dem Fonds zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen derzeit nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der Taxonomieverordnung. Daher kann es sein, dass der Anteil der Investitionen, die als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomieverordnung gelten, gleich null ist. Gemäß seiner ESG-Methodik kann der Fonds jedoch Investments halten, mit denen ein Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel angestrebt wird.

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 Übergangstätigkeiten im Sinne der Taxonomieverordnung, berücksichtigen.

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

Bei den Anlagen, die den übrigen und oben nicht aufgeführten Fonds zugrunde liegen, sind nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigt.

Die Anlagepolitik der einzelnen Fonds wird im jeweiligen Verkaufsprospekt näher beschrieben.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

30. Juni 2023

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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 28. Februar 2023 sowie der Ergebnisse für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr vermittelt,
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit der Generally Accepted Accounting Practice 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 worden ist 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 worden ist.

Wir haben den Jahresabschluss geprüft, der Teil des Jahresberichts und des geprüften Jahresabschlusses ist und Folgendes umfasst:

- die Bilanz per 28. Februar 2023,
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr,
- die Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- das Anlagenportfolio für jeden Teilfonds per 28. Februar 2023 und
- den Anhang zum Jahresabschluss für die Gesellschaft und für jeden ihrer Teilfonds einschließlich einer Beschreibung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze.

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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

Unabhängigkeit

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

Zusatz – Geänderter Bericht des Verwaltungsrats

Wie im geänderten Bericht des Verwaltungsrats dargelegt, wurde der ursprüngliche Bericht des Verwaltungsrats, der am 15. Juni 2023 unterzeichnet wurde, geändert, da die Informationen im ursprünglichen Anhang – Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft), der Teil des ursprünglichen Jahresberichts war, auf den im ursprünglichen Bericht des Verwaltungsrats verwiesen wurde, überarbeitet wurden. Nach Auffassung des Verwaltungsrats mussten daher in den ursprünglichen Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft) weitere Informationen aufgenommen werden. Für den Zeitraum vom 15. Juni 2023 (dem Datum unseres vorherigen Prüfberichts) bis zum Datum dieses Berichts sind wir nicht verpflichtet, eine Prüfung von Ereignissen nach dem Bilanzstichtag vorzunehmen und haben dies auch nicht getan.

Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt

Bei der Bildung unseres Prüfungsurteils zum Jahresabschluss, der nicht geändert wurde, weisen wir auf Erläuterung 2 zum Jahresabschluss hin, in der die Gründe beschrieben sind, warum der Jahresabschluss des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip aufgestellt wurde.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Mit Ausnahme des Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, bei denen eine andere Rechnungslegungsgrundlage als das Fortführungsprinzip herangezogen wurde, wie oben im Abschnitt „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ dargelegt, 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 Fähigkeit der Gesellschaft und der Teilfonds 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 Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund, Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund and Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund, FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund, Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, bei denen eine andere Rechnungslegungsgrundlage als das Fortführungsprinzip herangezogen wurde, wie oben im Abschnitt „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ dargelegt, 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 einen offensichtlichen wesentlichen Widerspruch oder eine wesentliche Fehldarstellung feststellen, müssen wir Handlungen vornehmen, um

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers – (Fortsetzung)

Berichterstattung über andere Informationen – (Fortsetzung)

zu prüfen, ob eine wesentlichen Fehldarstellung des Abschlusses oder eine wesentliche Fehldarstellung der sonstigen Informationen vorliegt. Wenn wir auf der Grundlage der von uns durchgeführten Prüfungshandlungen zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Fehldarstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, dies zu melden. Wir haben nichts zu berichten, was auf diesen Verantwortlichkeiten beruht.

Im Hinblick auf den geänderten Bericht des Verwaltungsrats haben wir auch geprüft, ob die gemäß 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 geänderten Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 mit dem Jahresabschluss überein und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften gemacht.
- Auf der Grundlage unserer Kenntnisse und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir bei der Prüfung gewonnen haben, haben wir keine wesentlichen fehlerhaften Angaben im Bericht des Verwaltungsrats festgestellt.

Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Abschlussprüfung

Verantwortlichkeiten der Directors für den Abschluss

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

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

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

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses

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

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

Eine nähere Beschreibung unserer Aufgaben zur Prüfung des Jahresabschlusses findet sich auf der Website der IAASA:

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 Erläuterungen erhalten, die wir für unsere Prüfung als notwendig erachten.
- Unserer Auffassung nach waren die Rechnungsunterlagen der Gesellschaft ausreichend, um eine umgehende und ordnungsgemäße Prüfung des Abschlusses zu gestatten.
- Der Abschluss stimmt mit den Rechnungsunterlagen überein.

Companies Act 2014 Ausnahmeberichterstattung

Vergütungen und Transaktionen der Directors

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

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

30. Juni 2023

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

Bericht der Verwahrstelle

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilssinhaber 30. Juni 2023

Für den Berichtszeitraum vom 1. März 2022 bis 28. Februar 2023 (der „Berichtszeitraum“)

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

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

Verantwortlichkeiten der Verwahrstelle

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

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

Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle

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

Bestätigungsvermerk

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

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

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

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 71,90 % (28. Februar 2022: 72,82 %)					
USA – 71,90 % (28. Februar 2022: 72,82 %)					
13.500	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,565 %, fällig 20.03.2023 *	13.500	1,62		
15.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,580 %, fällig 19.04.2023 *	15.000	1,80		
5.100	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,930 %, fällig 08.05.2023 *	5.103	0,61		
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,950 %, fällig 11.05.2023 *	10.007	1,20		
19.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,870 %, fällig 09.06.2023 *	19.013	2,28		
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 4,565 %, fällig 23.06.2023 *	9.999	1,20		
10.000	Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 4,600 %, fällig 26.07.2023 *	9.999	1,20		
10.000	Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.03.2023	9.994	1,20		
20.000	Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 08.03.2023	19.982	2,40		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.03.2023	10.000	1,20		
15.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 03.03.2023	14.996	1,80		
17.957	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.03.2023	17.937	2,15		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 16.03.2023	9.982	1,20		
15.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.04.2023	14.934	1,79		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.04.2023	9.928	1,19		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 28.04.2023	9.925	1,19		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 24.05.2023	9.889	1,19		
10.000	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 31.05.2023	9.879	1,19		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,595 %, fällig 01.03.2023 *	10.000	1,20		
22.900	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,600 %, fällig 01.03.2023 *	22.900	2,75		
12.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,595 %, fällig 06.03.2023 *	12.000	1,44		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,605 %, fällig 10.03.2023 *	10.000	1,20		
14.100	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,570 %, fällig 13.03.2023 *	14.100	1,69		
6.700	Federal Home Loan Banks, 4,565 %, fällig 15.03.2023 *	6.700	0,80		
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,560 %, fällig 23.03.2023 *	15.000	1,80		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0002, 4,620 %, fällig 03.04.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,600 %, fällig 04.04.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,620 %, fällig 06.04.2023 *	10.000	1,20		
1.300	Federal Home Loan Banks, 4,610 %, fällig 10.04.2023 *	1.300	0,15		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,610 %, fällig 18.04.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,605 %, fällig 01.05.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,590 %, fällig 03.05.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,580 %, fällig 04.05.2023 *	10.000	1,20		
18.000	Federal Home Loan Banks, 4,580 %, fällig 10.05.2023 *	18.000	2,16		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,580 %, fällig 11.05.2023 *	10.000	1,20		
15.000	Federal Home Loan Banks, Series 0000, 4,590 %, fällig 23.05.2023 *	15.000	1,80		
10.000	Federal Home Loan Banks, Series 0001, 4,590 %, fällig 26.05.2023 *	10.000	1,20		
10.000	Federal Home Loan Banks, 4,620 %, fällig 25.07.2023 *	10.000	1,20		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.03.2023	9.993	1,20		
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 09.03.2023	14.985	1,80		
25.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 14.03.2023	24.959	2,99		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.03.2023	9.975	1,20		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.03.2023	9.966	1,19		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.04.2023	9.957	1,19		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 13.04.2023	9.945	1,19		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.04.2023	9.938	1,19		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 25.04.2023	9.929	1,19		
15.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 27.04.2023	14.891	1,79		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.05.2023	9.918	1,19		
10.000	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 13.07.2023	9.825	1,18		
10.000	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 0,064 %, fällig 31.07.2023 *	10.000	1,20		
		599.348	71,90		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 599.348 \$)				599.348	71,90
Umgekehrte Pensionsgeschäfte – 29,37 % (28. Februar 2022: 29,37 %)					
USA – 29,37 % (28. Februar 2022: 29,37 %)					
35.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 35.004.385 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 35.704.490 USD), 4,510 %, fällig 01.03.2023	35.000	4,20		
55.000	HSBC Bank (USA), Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 55.006.890 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 56.107.049 USD), 4,510 %, fällig 01.03.2023	55.000	6,60		
75.000	JP Morgan Securities LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 75.009.417 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 76.509.696 USD), 4,520 %, fällig 01.03.2023	75.000	8,99		
50.000	Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 50.006.236 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 51.000.064 USD), 4,490 %, fällig 01.03.2023	50.000	6,00		
29.848	TD Securities (USA) LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 29.851.772 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 30.444.960 USD), 4,550 %, fällig 01.03.2023	29.848	3,58		
		244.848	29,37		
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte (Anschaffungskosten 244.848 \$)				244.848	29,37
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				844.196	101,27
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				844.196	101,27
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten				-10.581	-1,27
Gesamtvermögen				833.615 \$	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 2023.					
Verteilung des Gesamtvermögens					
				% des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				70,83	
Geldmarktinstrumente				28,93	
Sonstige Vermögenswerte				0,24	
Gesamtvermögen				100,00	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 9,59 % (28. Februar 2022: 9,40 %)			Forderungsbesicherte Wertpapiere – 36,20 % (28. Februar 2022: 25,49 %)		
167 ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2003-NC1, Series 2003 NC1, Class A1, 5,297 %, fällig 25.07.2033 *	161	0,12	510 AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 6,806 %, fällig 17.06.2039 *	511	0,39
307 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144A, 4,194 %, fällig 05.06.2049	299	0,23	27 Banc of America Mortgage 2003-C Trust, Series 2003 C, Class B1, 2,735 %, fällig 25.04.2033 *	6	–
415 Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, Series 2003 W3, Class M1, 3,734 %, fällig 25.09.2033 *	381	0,29	23 Bear Stearns ALT-A Trust 2004-6, Series 2004 6, Class M1, 5,442 %, fällig 25.07.2034 *	23	0,02
500 Benefit Street Partners CLO VIII Ltd, Series 2015 8A, Class A1AR, 144A, 5,908 %, fällig 20.01.2031 *	496	0,38	10.841 Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5, Class XA, 0,471 %, fällig 15.07.2051 *	197	0,15
630 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 5,972 %, fällig 15.07.2034 *	619	0,47	879 BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class A, 144A, 5,838 %, fällig 15.07.2035 *	864	0,65
270 Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 5,912 %, fällig 17.07.2034 *	266	0,20	254 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 5,578 %, fällig 15.02.2038 *	251	0,19
490 CBAM 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class A1, 144A, 6,058 %, fällig 20.07.2030 *	488	0,37	100 CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Class A4, 3,631 %, fällig 10.02.2050	93	0,07
77 Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2001 HE22, Class A1, 5,097 %, fällig 25.02.2032 *	74	0,05	130 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class B, 4,175 %, fällig 10.07.2047 *	124	0,09
32 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Series 2007 13, Class A2, 5,417 %, fällig 25.10.2047 *	30	0,02	3.846 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 1,001 %, fällig 15.11.2049 *	112	0,08
148 CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Series 2004 5, Class 2A, 5,117 %, fällig 25.10.2034 *	140	0,11	385 COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class A1, 144A, 1,665 %, fällig 25.09.2061 *	340	0,26
30 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Class 2A1A, 4,728 %, fällig 15.07.2036 *	28	0,02	10 COMM 2013-CRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Class AM, 4,300 %, fällig 10.10.2046	9	0,01
227 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 1A, 4,728 %, fällig 15.01.2037 *	211	0,16	139 Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2, Class XA, 1,057 %, fällig 10.03.2047 *	1	–
159 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-I, Series 2006 I, Class 2A, 4,728 %, fällig 15.01.2037 *	147	0,11	54 COMM 2015-LC19 Mortgage Trust, Series 2015 LC19, Class ASB, 3,040 %, fällig 10.02.2048	52	0,04
174 EFS Volunteer No 2 LLC, Series 2012 1, Class A2, 144A, 5,967 %, fällig 25.03.2036 *	172	0,13	200 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	193	0,15
420 Golub Capital Partners Clo 57M Ltd, Series 2021 57A, Class A1, 144A, 6,308 %, fällig 25.10.2034 *	410	0,31	340 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 7,584 %, fällig 25.03.2042 *	344	0,26
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class A2, 144A, 5,802 %, fällig 15.04.2031 *	247	0,19	100 CSAIL 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	93	0,07
320 Greywolf CLO V Ltd, Series 2015 1A, Class A1R, 144A, 5,978 %, fällig 27.01.2031 *	318	0,24	340 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037	307	0,23
769 Home Equity Asset Trust 2006-4, Series 2006 4, Class 2A4, 5,177 %, fällig 25.08.2036 *	750	0,57	420 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class B, 144A, 4,185 %, fällig 15.09.2037	360	0,27
339 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	264	0,20	371 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class A2, 144A, 3,500 %, fällig 25.02.2048 *	331	0,25
656 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 5,367 %, fällig 25.02.2034 *	627	0,48	1.001 CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B2, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048 *	848	0,64
274 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Series 2004 4, Class M1, 5,517 %, fällig 25.10.2034 *	255	0,19	143 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Class 1M2, 7,617 %, fällig 25.07.2024 *	146	0,11
454 Merrill Lynch Mortgage Investors Trust Series 2004-WMC5, Series 2004 WMC5, Class M1, 5,547 %, fällig 25.07.2035 *	438	0,33	3 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C04, Class 2M2, 9,617 %, fällig 25.11.2024 *	4	–
500 MKS CLO 2017-2 Ltd, Series 2017 2A, Class A, 144A, 5,998 %, fällig 20.01.2031 *	495	0,38	1 Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	–	–
422 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Series 2004 NC8, Class M1, 5,532 %, fällig 25.09.2034 *	399	0,30	4 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	1	–
96 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2005-NC2, Series 2005 NC2, Class M4, 5,532 %, fällig 25.03.2035 *	94	0,07	8 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	1	–
395 Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	306	0,23	8 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	2	–
359 Navient Student Loan Trust 2017-3, Series 2017 3A, Class A3, 144A, 5,667 %, fällig 26.07.2066 *	357	0,27	6 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	–	–
350 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd, Series 2018 29A, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig 19.10.2031 *	348	0,26	100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	81	0,06
102 NovaStar Mortgage Funding Trust Series 2003-3, Series 2003 3, Class A1, 5,327 %, fällig 25.12.2033 *	99	0,07	2.400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	2.034	1,54
480 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class AR, 144A, 6,012 %, fällig 15.10.2034 *	474	0,36	1.100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	968	0,73
240 Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144A, 6,028 %, fällig 20.07.2034 *	237	0,18	1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	911	0,69
440 OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class A1A, 144A, 5,868 %, fällig 20.01.2031 *	438	0,33	300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	282	0,21
67 SBA Small Business Investment Cos, Series 2018 10B, Class 1, 3,548 %, fällig 10.09.2028	63	0,05	700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	675	0,51
376 Securitized Asset Backed Receivables LLC Trust 2005-OP1, Series 2005 OP1, Class M1, 5,232 %, fällig 25.01.2035 *	349	0,27	300 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	295	0,22
86 SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class A4A, 5,009 %, fällig 16.12.2041 *	82	0,06	500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	499	0,38
357 SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 9,338 %, fällig 15.10.2041 *	383	0,29	1 Fannie Mae Pool '888795', 5,500 %, fällig 01.11.2036	2	–
166 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	152	0,12	34 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01.10.2044	34	0,03
464 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class AA, 144A, 2,301 %, fällig 28.02.2033	424	0,32	41 Fannie Mae Pool '890827', 3,500 %, fällig 01.12.2037	39	0,03
490 Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1, 144A, 5,988 %, fällig 20.07.2034 *	481	0,36	24 Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig 01.06.2043	23	0,02
660 Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144A, 5,985 %, fällig 18.10.2031 *	655	0,50	209 Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig 01.02.2041	206	0,16
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 12.904 \$)	12.657	9,59	9 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01.05.2040	9	0,01
			68 Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 01.10.2046	62	0,05
			53 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01.11.2046	50	0,04
			39 Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 01.12.2046	36	0,03
			20 Fannie Mae Pool 'AM8674', 2,810 %, fällig 01.04.2025	19	0,01
			95 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig 01.06.2030	86	0,07
			57 Fannie Mae Pool 'AN4927', 3,450 %, fällig 01.03.2029	54	0,04
			58 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig 01.05.2029	55	0,04
			44 Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig 01.06.2042	43	0,03
			25 Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01.09.2042	22	0,02
			19 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 01.06.2043	17	0,01
			42 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	38	0,03
			44 Fannie Mae Pool 'AS6328', 3,500 %, fällig 01.12.2045	41	0,03
			250 Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, fällig 01.06.2046	233	0,18
			94 Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 01.08.2046	83	0,06
			59 Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 01.09.2046	53	0,04
			22 Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 01.02.2037	21	0,02
			40 Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 01.02.2047	36	0,03
			45 Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig 01.05.2047	43	0,03
			19 Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig 01.06.2043	19	0,01
			27 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	24	0,02
			60 Fannie Mae Pool 'AW9453', 3,500 %, fällig 01.08.2044	56	0,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	USD			USD	USD	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
454	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	392	0,30	111	Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	97	0,07
247	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 01.02.2051	203	0,15	29	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20.06.2044	27	0,02
486	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 01.05.2051	399	0,30	10	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20.03.2045	10	0,01
88	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig 01.06.2051	72	0,05	110	Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20.03.2046	103	0,08
90	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig 01.01.2052	77	0,06	59	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	55	0,04
378	Freddie Mac Pool 'RA6694', 2,000 %, fällig 01.01.2052	308	0,23	15	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	14	0,01
352	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01.09.2041	299	0,23	46	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	43	0,03
108	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	87	0,07	15	Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20.07.2046	14	0,01
55	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	44	0,03	88	Ginnie Mae II Pool 'MA3873', 3,000 %, fällig 20.08.2046	80	0,06
93	Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig 01.02.2042	79	0,06	11	Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, fällig 20.09.2046	16	0,01
75	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	63	0,05	19	Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20.11.2046	17	0,01
91	Freddie Mac Pool 'SD0745', 2,000 %, fällig 01.11.2051	75	0,06	22	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	20	0,01
92	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	79	0,06	158	Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	151	0,11
999	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	955	0,72	133	Ginnie Mae II Pool 'MA4719', 3,500 %, fällig 20.09.2047	124	0,09
99	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig 01.12.2052	101	0,08	91	Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20.11.2047	87	0,07
49	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	44	0,03	12	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20.12.2047	11	0,01
148	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	127	0,10	60	Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20.12.2047	57	0,04
157	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	135	0,10	11	Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, fällig 20.02.2048	10	0,01
590	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	507	0,38	106	Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20.02.2048	99	0,07
48	Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, fällig 01.01.2038	45	0,03	28	Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20.02.2048	27	0,02
8	Freddie Mac Pool 'Z17269', 5,000 %, fällig 01.03.2038	8	0,01	38	Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20.03.2048	36	0,03
25	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	24	0,02	83	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	82	0,06
16	Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, fällig 01.11.2048	16	0,01	40	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	39	0,03
4	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 4,500 %, fällig 01.12.2038	4	–	63	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	62	0,05
7	Freddie Mac Pool 'ZS3569', 6,000 %, fällig 01.10.2036	7	0,01	28	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	27	0,02
100	Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig 01.01.2038	94	0,07	278	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	270	0,20
49	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	44	0,03	15	Ginnie Mae II Pool 'MA5762', 3,500 %, fällig 20.02.2049	14	0,01
4	Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 1,642 %, fällig 15.01.2040 *	–	–	93	Ginnie Mae II Pool 'MA6933', 3,500 %, fällig 20.10.2050	86	0,07
22	Freddie Mac REMICS 3947, Class SG, 1,362 %, fällig 15.10.2041 *	2	–	217	Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig 20.12.2050	213	0,16
12	Freddie Mac REMICS 4194, Class BI, 3,500 %, fällig 15.04.2043	2	–	67	Ginnie Mae II Pool 'MA7193', 2,500 %, fällig 20.02.2051	59	0,04
3	Freddie Mac REMICS 4298, Class PI, 4,000 %, fällig 15.04.2043	–	–	332	Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	298	0,23
29	Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	25	0,02	2.100	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	1.817	1,38
69	Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	10	0,01	800	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	714	0,54
245	Freddie Mac REMICS 5010, Class JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	38	0,03	300	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	276	0,21
83	Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	13	0,01	300	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	291	0,22
172	Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	23	0,02	900	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	889	0,67
74	Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	11	0,01	400	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	402	0,30
349	Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	55	0,04	5	Government National Mortgage Association, Series 2007 51, Class SG, 1,982 %, fällig 20.08.2037 *	–	–
79	Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	12	0,01	9	Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 5,748 %, fällig 20.11.2059 *	9	0,01
440	Freddie Mac REMICS 5085, Class NI, 2,000 %, fällig 25.03.2051	50	0,04	1	Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Class HS, 2,052 %, fällig 20.01.2040 *	–	–
182	Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	26	0,02	20	Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,742 %, fällig 20.08.2058 *	20	0,02
200	Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	182	0,14	33	Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 4,842 %, fällig 20.11.2060 *	33	0,02
420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 7,384 %, fällig 25.04.2042 *	421	0,32	37	Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 4,892 %, fällig 20.03.2061 *	37	0,03
71	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Series T 56, Class 2AF, 5,017 %, fällig 25.05.2043 *	70	0,05	92	Government National Mortgage Association, Series 2012 112, Class IO, 0,130 %, fällig 16.02.2053 *	–	–
17	Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, fällig 15.07.2031	18	0,01	44	Government National Mortgage Association, Series 2012 27, Class IO, 0,271 %, fällig 16.04.2053 *	–	–
10	Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, fällig 15.08.2031	10	0,01	18	Government National Mortgage Association, Series 2012 34, Class SA, 1,452 %, fällig 20.03.2042 *	2	–
3	Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, fällig 15.04.2032	3	–	21	Government National Mortgage Association, Series 2012 44, Class IO, 0,029 %, fällig 16.03.2049 *	–	–
66	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	62	0,05	15	Government National Mortgage Association, Series 2012 H18, Class NA, 4,912 %, fällig 20.08.2062 *	15	0,01
38	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	35	0,03	36	Government National Mortgage Association, Series 2012 H27, Class AI, 1,621 %, fällig 20.10.2062 *	1	–
54	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	50	0,04	16	Government National Mortgage Association, Series 2012 H30, Class GA, 4,742 %, fällig 20.12.2062 *	16	0,01
122	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	113	0,09	77	Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,845 %, fällig 16.11.2047 *	70	0,05
7	Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, fällig 20.10.2040	8	0,01	20	Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,018 %, fällig 16.02.2046 *	–	–
7	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20.01.2041	7	–	70	Government National Mortgage Association, Series 2013 H08, Class BF, 4,792 %, fällig 20.03.2063 *	70	0,05
4	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	4	–	41	Government National Mortgage Association, Series 2014 105, Class IO, 0,121 %, fällig 16.06.2054 *	–	–
16	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	16	0,01	8	Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,537 %, fällig 16.06.2048 *	8	0,01
8	Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, fällig 20.11.2041	8	0,01	12	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,147 %, fällig 16.02.2048 *	–	–
14	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	13	0,01	50	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,629 %, fällig 16.09.2055 *	1	–
464	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20.07.2047	446	0,34	250	Government National Mortgage Association, Series 2014 92, Class IX, 0,102 %, fällig 16.05.2054 *	1	–
11	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	10	0,01	443	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 4,822 %, fällig 20.10.2064 *	441	0,33
126	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	113	0,09	46	Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	8	0,01
26	Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	24	0,02	31	Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class MI, 5,500 %, fällig 20.03.2045	5	–
59	Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, fällig 20.03.2051	49	0,04	569	Government National Mortgage Association, Series 2015 5, Class IK, 0,296 %, fällig 16.11.2054 *	5	–
88	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20.03.2051	71	0,05	265	Government National Mortgage Association, Series 2016 128, Class IO, 0,737 %, fällig 16.09.2056 *	9	0,01
94	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	84	0,06	79	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050	11	0,01
97	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	84	0,06				
96	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	88	0,07				
183	Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, fällig 20.04.2052	159	0,12				
27	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20.10.2047	25	0,02				
30	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	28	0,02				
80	Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	75	0,06				
34	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	33	0,02				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert			USD	Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
160	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	22	0,02	460	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Class B, 4,188 %, fällig 15.11.2050 *	413	0,31
78	Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig 20.08.2050	11	0,01	1.529	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class XA, 0,550 %, fällig 15.10.2057 *	10	0,01
81	Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	12	0,01	15	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class ASB, 3,522 %, fällig 15.03.2047	15	0,01
83	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	12	0,01	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 51.915 \$)			
81	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	11	0,01	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 37,25 % (28. Februar 2022: 39,60 %)			
330	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class YI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	45	0,03	Australien – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			
4.429	Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,422 %, fällig 16.10.2060 *	408	0,31	70	BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	68	0,05
3.245	Government National Mortgage Association, Series 2020 179, Class IO, 1,008 %, fällig 16.09.2062 *	226	0,17	Belgien – 0,45 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			
392	Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	42	0,03	120	Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2026	115	0,09
1.669	Government National Mortgage Association, Series 2020 195, Class IO, 0,926 %, fällig 16.12.2062 *	113	0,09	140	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,000 %, fällig 13.04.2028	134	0,10
269	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	44	0,03	60	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	55	0,04
73	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	12	0,01	180	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	158	0,12
184	Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class FP, 4,892 %, fällig 20.06.2069 *	182	0,14	15	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	13	0,01
191	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 5,542 %, fällig 20.05.2070 *	190	0,14	100	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	87	0,07
117	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 5,642 %, fällig 20.04.2070 *	118	0,09	30	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	30	0,02
65	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 3,084 %, fällig 20.07.2070 *	63	0,05	Brasilien – 0,57 % (28. Februar 2022: 0,81 %)			
5.961	Government National Mortgage Association, Series 2021 10, Class IO, 0,983 %, fällig 16.05.2063 *	433	0,33	10	Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	10	0,01
171	Government National Mortgage Association, Series 2021 115, Class MI, 2,500 %, fällig 20.05.2051	19	0,01	50	Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	42	0,03
5.043	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,112 %, fällig 16.01.2061 *	378	0,29	490	Suzano Austria GmbH, 6,000 %, fällig 15.01.2029	481	0,36
200	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class B, 1,850 %, fällig 16.02.2061	118	0,09	20	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	21	0,02
882	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	44	0,03	200	Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	204	0,15
100	Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	85	0,06	Kanada – 0,83 % (28. Februar 2022: 0,63 %)			
570	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Series 2018 3PCK, Class B, 144A, 7,338 %, fällig 15.09.2031 *	535	0,41	90	Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025	83	0,06
471	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class A, 144A, 6,388 %, fällig 15.09.2031 *	404	0,31	30	Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	27	0,02
10	GS Mortgage Securities Trust 2013-GC16, Series 2013 GC16, Class B, 5,161 %, fällig 10.11.2046 *	10	0,01	80	Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig 11.04.2025	77	0,06
75	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-9, Series 2005 9, Class 2A1B, 5,331 %, fällig 20.06.2035 *	68	0,05	130	Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11.06.2025	119	0,09
450	Independence Plaza Trust 2018-INDP, Series 2018 INDP, Class A, 144A, 3,763 %, fällig 10.07.2035	423	0,32	70	Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	61	0,05
10	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2013-C17, Series 2013 C17, Class B, 4,883 %, fällig 15.01.2047 *	10	0,01	40	Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	40	0,03
120	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class AS, 4,202 %, fällig 15.09.2047 *	116	0,09	40	Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039	41	0,03
430	Mill City Mortgage Trust 2015-2, Series 2015 2, Class M3, 144A, 3,688 %, fällig 25.09.2057 *	416	0,31	350	Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, fällig 02.12.2031	292	0,22
100	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C18, Series 2014 C18, Class AS, 4,110 %, fällig 15.10.2047 *	96	0,07	80	Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, fällig 02.12.2041	61	0,05
227	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 5,563 %, fällig 15.11.2034 *	223	0,17	130	Royal Bank of Canada, 1,600 %, fällig 17.04.2023	129	0,10
550	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class A, 144A, 3,047 %, fällig 15.08.2036	514	0,39	60	Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025	55	0,04
172	New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Series 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.08.2055 *	159	0,12	120	Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig 04.05.2032	108	0,08
258	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	234	0,18	Chile – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,35 %)			
255	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-2, Series 2017 2A, Class B1, 144A, 4,500 %, fällig 25.03.2057 *	236	0,18	400	Corp Nacional del Cobre de Chile, 3,625 %, fällig 01.08.2027	374	0,28
288	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	268	0,20	China – 0,45 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			
200	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25.10.2058 *	180	0,14	80	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	75	0,06
5	Thornburg Mortgage Securities Trust 2007-4, Series 2007 4, Class 1A1, 3,275 %, fällig 25.09.2037 *	5	-	420	Prosus NV, 144A, 4,027 %, fällig 03.08.2050	266	0,20
300	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,152 %, fällig 15.12.2051 *	262	0,20	250	Sinopec Group Overseas Development 2014 Ltd, 4,375 %, fällig 10.04.2024	248	0,19
324	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR6 Trust, Series 2005 AR6, Class 2A1A, 5,077 %, fällig 25.04.2045 *	313	0,24	Kolumbien – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			
1.001	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-NXS1, Series 2015 NXS1, Class XA, 1,072 %, fällig 15.05.2048 *	16	0,01	650	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	429	0,33
150	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A3, 2,807 %, fällig 15.11.2059	137	0,10	Dänemark – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,18 %)			
1.436	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class XA, 1,182 %, fällig 15.11.2059 *	47	0,04	200	Danske Bank A/S, 144A, 3,875 %, fällig 12.09.2023	198	0,15
				200	Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	200	0,15
				Frankreich – 0,73 % (28. Februar 2022: 0,64 %)			
				200	BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	198	0,15
				400	BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	370	0,28
				200	BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	189	0,14
				210	BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	206	0,16
				Indien – 0,14 % (28. Februar 2022: 0,11 %)			
				270	Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12.01.2052	189	0,14
				Irland – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,18 %)			
				230	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	203	0,15
				210	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	179	0,14
				Japan – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
				200	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *	192	0,15

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Kasachstan – 0,44 % (28. Februar 2022 0,30 %)					
650 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	588	0,44			
Macau – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
200 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig 08.08.2025	194	0,15			
Mexiko – 0,62 % (28. Februar 2022: 0,55 %)					
400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig 26.07.2033	304	0,23			
200 Orbia Advance Corp SAB de CV, 144A, 2,875 %, fällig 11.05.2031	158	0,12			
380 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	356	0,27			
	818	0,62			
Niederlande – 0,65 % (28. Februar 2022: 0,64 %)					
250 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	242	0,18			
260 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21.05.2025	250	0,19			
120 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	105	0,08			
10 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	9	0,01			
140 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	117	0,09			
180 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	133	0,10			
	856	0,65			
Peru – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,58 %)					
400 Petroleos del Peru SA, 4,750 %, fällig 19.06.2032	307	0,23			
200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19.06.2047	133	0,10			
	440	0,33			
Südafrika – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	282	0,21			
Spanien – 0,52 % (28. Februar 2022: 0,42 %)					
600 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	563	0,43			
150 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	126	0,09			
	689	0,52			
Schweden – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
200 Swedbank AB, 144A, 1,300 %, fällig 02.06.2023	198	0,15			
Schweiz – 1,25 % (28. Februar 2022: 0,84 %)					
310 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05.05.2023	307	0,23			
370 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, fällig 09.01.2025	374	0,28			
250 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09.04.2025	227	0,17			
500 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	397	0,30			
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	176	0,14			
200 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	171	0,13			
	1.652	1,25			
Taiwan – 0,36 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	473	0,36			
Vereinigte Arabische Emirate – 0,54 % (28. Februar 2022: 0,63 %)					
730 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	707	0,54			
Vereinigtes Königreich – 1,57 % (28. Februar 2022: 1,45 %)					
200 Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	191	0,14			
200 HSBC Holdings Plc, 2,633 %, fällig 07.11.2025 *	189	0,14			
350 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	339	0,26			
400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	374	0,28			
200 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24.03.2026	193	0,15			
200 Nationwide Building Society, 144A, 4,363 %, fällig 01.08.2024 *	198	0,15			
200 NatWest Group Plc, 4,519 %, fällig 25.06.2024 *	199	0,15			
200 NatWest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025 *	196	0,15			
200 NatWest Group Plc, 4,892 %, fällig 18.05.2029 *	191	0,15			
	2.070	1,57			
USA – 25,89 % (28. Februar 2022: 28,00 %)					
10 3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	8	0,01	40 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	24	0,02
90 3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	70	0,05	200 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	187	0,14
10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,01	60 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	56	0,04
100 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	98	0,07	100 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	80	0,06
100 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	97	0,07	80 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	66	0,05
20 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	19	0,01	250 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	229	0,17
90 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig 21.11.2026	83	0,06	80 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	79	0,06
760 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	672	0,51	410 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	264	0,20
10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	9	0,01	30 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	26	0,02
20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	17	0,01	210 American Express Co, 2,500 %, fällig 30.07.2024	202	0,15
210 Adobe Inc, 2,300 %, fällig 01.02.2030	180	0,14	90 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	85	0,07
10 Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	10	0,01	16 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	15	0,01
10 Aetna Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2047	8	0,01	20 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	18	0,01
90 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	85	0,06	30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	25	0,02
70 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	68	0,05	11 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	10	0,01
210 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	166	0,13	260 Apple Inc, 1,125 %, fällig 11.05.2025	240	0,18
70 Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	47	0,04	200 Applied Materials Inc, 1,750 %, fällig 01.06.2030	163	0,12
			70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	66	0,05
			190 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	169	0,13
			130 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	110	0,08
			40 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	31	0,02
			60 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	46	0,04
			10 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	10	0,01
			10 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	10	0,01
			37 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	30	0,02
			28 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	23	0,02
			40 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	27	0,02
			116 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	79	0,06
			10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	0,01
			63 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	43	0,03
			90 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	90	0,07
			310 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	302	0,23
			10 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	10	0,01
			50 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	48	0,04
			260 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	236	0,18
			160 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	154	0,12
			180 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	166	0,13
			193 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	176	0,13
			220 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	204	0,16
			200 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	183	0,14
			210 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	174	0,13
			130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	104	0,08
			130 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	106	0,08
			140 Bank of America Corp, 5,000 %, fällig 21.01.2044	133	0,10
			130 Bank of America Corp, 3,946 %, fällig 23.01.2049 *	103	0,08
			250 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	201	0,15
			30 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	28	0,02
			83 Becton Dickinson and Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	74	0,06
			80 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	71	0,05
			340 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	292	0,22
			40 BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig 11.02.2026	38	0,03
			110 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	104	0,08
			80 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	73	0,06
			170 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	115	0,09
			19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	17	0,01
			110 Bristol-Myers Squibb Co, 4,250 %, fällig 26.10.2049	95	0,07
			290 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	214	0,16
			410 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	342	0,26
			10 Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	7	0,01
			180 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	176	0,13
			310 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	285	0,22
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	75	0,06
			100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	86	0,07
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	75	0,06
			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	26	0,02
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	82	0,06
			10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	8	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	USD			USD	USD	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)							
USA – (Fortsetzung)							
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	84		0,06	40 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 24.03.2031	34		0,03
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	31		0,02	50 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	43		0,03
40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	29		0,02	40 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	37		0,03
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	47		0,04	210 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	199		0,15
100 Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	94		0,07	160 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	137		0,10
30 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	29		0,02	20 Enterprise Products Operating LLC, 7,550 %, fällig 15.04.2038	23		0,02
150 Cigna Group/The, 4,125 %, fällig 15.11.2025	146		0,11	60 Enterprise Products Operating LLC, 5,700 %, fällig 15.02.2042	59		0,05
320 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	307		0,23	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15.03.2044	18		0,01
20 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	18		0,01	20 Enterprise Products Operating LLC, 4,800 %, fällig 01.02.2049	18		0,01
30 Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	29		0,02	170 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	137		0,10
60 Cintas Corp No 2, 4,000 %, fällig 01.05.2032	56		0,04	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	15		0,01
80 Citigroup Inc, 1,678 %, fällig 15.05.2024 *	79		0,06	10 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	7		0,01
190 Citigroup Inc, 0,776 %, fällig 30.10.2024 *	184		0,14	30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	25		0,02
60 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	59		0,04	140 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	135		0,10
60 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	60		0,05	160 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	141		0,11
90 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	85		0,07	190 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	183		0,14
30 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	29		0,02	100 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	103		0,08
180 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	172		0,13	50 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	45		0,03
90 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	87		0,07	180 FirstEnergy Corp, Series B, 4,150 %, fällig 15.07.2027	168		0,13
150 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	137		0,10	200 FirstEnergy Corp, Series C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	179		0,14
200 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	183		0,14	40 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	38		0,03
220 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	205		0,16	30 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	27		0,02
280 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	230		0,17	30 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	29		0,02
120 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	104		0,08	10 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	10		0,01
30 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	28		0,02	10 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	9		0,01
90 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	114		0,09	30 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	28		0,02
77 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	68		0,05	10 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	9		0,01
10 Citigroup Inc, 4,750 %, fällig 18.05.2046	9		0,01	100 Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	96		0,07
60 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	44		0,03	3 Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, Ewige Anleihe *	2		-
30 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	20		0,02	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	145		0,11
120 Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	112		0,09	140 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	136		0,10
140 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	134		0,10	330 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	300		0,23
80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	72		0,06	90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	85		0,06
130 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	123		0,09	40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	37		0,03
121 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	138		0,10	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	165		0,13
80 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	69		0,05	450 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	422		0,32
10 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	8		0,01	30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	32		0,02
40 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	33		0,03	200 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	186		0,14
20 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	15		0,01	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	9		0,01
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	16		0,01	50 Guardian Life Global Funding, 144A, 1,100 %, fällig 23.06.2025	45		0,03
20 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	16		0,01	4 Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	4		-
20 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	16		0,01	30 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	27		0,02
10 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	8		0,01	80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	69		0,05
90 Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15.01.2051	57		0,04	40 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	35		0,03
111 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	72		0,05	110 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	88		0,07
54 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	34		0,03	20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	17		0,01
10 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	9		0,01	60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	45		0,03
20 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	22		0,02	20 Humana Inc, 4,500 %, fällig 01.04.2025	20		0,02
50 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	45		0,03	130 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	124		0,09
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	24		0,02	90 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	82		0,06
70 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig 09.05.2027	68		0,05	30 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	23		0,02
90 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	83		0,06	50 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	49		0,04
170 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	161		0,12	40 Intel Corp, 5,200 %, fällig 10.02.2033	39		0,03
100 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	79		0,06	90 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	78		0,06
210 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	197		0,15	20 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	13		0,01
390 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	360		0,27	130 Johnson & Johnson, 3,700 %, fällig 01.03.2046	110		0,08
40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	38		0,03	300 Johnson Controls International plc / Tyco Fire & Security Finance SCA, 1,750 %, fällig 15.09.2030	240		0,18
100 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	96		0,07	70 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	69		0,05
110 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	99		0,08	230 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	227		0,17
20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	16		0,01	190 JPMorgan Chase & Co, 0,563 %, fällig 16.02.2025 *	180		0,14
90 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	71		0,05	100 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	93		0,07
100 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	91		0,07	70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	68		0,05
40 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	33		0,03	100 JPMorgan Chase & Co, 4,250 %, fällig 01.10.2027	96		0,07
40 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	36		0,03	110 JPMorgan Chase & Co, 3,625 %, fällig 01.12.2027	103		0,08
250 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	225		0,17	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	122		0,09
3 CVS Pass-Through Trust, 5,880 %, fällig 10.01.2028	3		-	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	104		0,08
110 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	94		0,07	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	174		0,13
220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles LP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	214		0,16	40 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	32		0,02
220 Delta Air Lines Inc / SkyMiles LP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	209		0,16	115 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	106		0,08
160 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	161		0,12	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	34		0,03
18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	18		0,01				
30 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	28		0,02				
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	37		0,03				
70 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	58		0,04				
200 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	170		0,13				
170 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	150		0,11				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
30 Kimberly-Clark Corp, 3,100 %, fällig 26.03.2030	27	0,02	110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	77	0,06
70 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	68	0,05	30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	20	0,02
240 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	231	0,18	170 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	180	0,14
20 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	19	0,01	140 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig 15.05.2030	122	0,09
104 Lehman Swap Receipt, Nullkupon, Ewige Anleihe [†]	–	–	150 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	116	0,09
70 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15.09.2028	58	0,04	140 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05.02.2030	119	0,09
50 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	48	0,04	130 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	95	0,07
260 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	234	0,18	30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	28	0,02
400 MassMutual Global Funding II, 144A, 0,850 %, fällig 09.06.2023	395	0,30	40 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	38	0,03
190 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	160	0,12	30 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	25	0,02
30 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	28	0,02	20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	16	0,01
50 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	47	0,04	50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	47	0,04
30 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	28	0,02	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	15	0,01
80 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	66	0,05	50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2043	44	0,03
80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	73	0,06	40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	35	0,03
110 McDonald's Corp, 4,875 %, fällig 09.12.2045	100	0,08	20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	18	0,01
20 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	15	0,01	50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	39	0,03
40 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	33	0,03	110 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	75	0,06
15 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	14	0,01	60 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	47	0,04
80 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	64	0,05	20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	14	0,01
215 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	216	0,16	150 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01.05.2030	124	0,09
270 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,900 %, fällig 08.06.2023	267	0,20	40 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	37	0,03
70 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	68	0,05	40 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 16.03.2027	39	0,03
60 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 06.01.2050	40	0,03	30 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22.03.2027	28	0,02
100 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	72	0,05	100 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22.03.2028	86	0,07
20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, fällig 15.05.2028	19	0,01	105 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	101	0,08
90 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	83	0,06	30 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	28	0,02
260 Morgan Stanley, Series I, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	240	0,18	100 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	88	0,07
150 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	140	0,11	310 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	254	0,19
160 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	148	0,11	146 Verizon Communications Inc, 2,355 %, fällig 15.03.2032	115	0,09
210 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	175	0,13	290 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	270	0,20
200 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	177	0,13	60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01.11.2034	55	0,04
120 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	112	0,09	20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	20	0,02
100 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	85	0,07	180 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	122	0,09
40 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	35	0,03	30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	23	0,02
60 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.12.2047	52	0,04	70 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	57	0,04
80 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	64	0,05	70 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	63	0,05
100 New York Life Global Funding, 144A, 0,950 %, fällig 24.06.2025	90	0,07	130 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	103	0,08
110 NIKE Inc, 2,850 %, fällig 27.03.2030	98	0,07	70 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20.11.2050	44	0,03
60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	48	0,04	30 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	29	0,02
10 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	8	0,01	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,02
180 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	148	0,11	50 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	41	0,03
110 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	84	0,06	30 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22.09.2031	24	0,02
270 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	241	0,18	20 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	23	0,02
20 Oracle Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2030	17	0,01	30 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	28	0,02
50 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	47	0,04	60 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,054 %, fällig 15.03.2029	54	0,04
160 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	133	0,10	210 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, fällig 15.03.2032	181	0,14
60 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	56	0,04	20 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	16	0,01
50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	43	0,03	240 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	188	0,14
70 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	55	0,04	61 Wells Fargo & Co, 4,480 %, fällig 16.01.2024	60	0,05
20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	14	0,01	140 Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02.06.2024 *	139	0,11
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	19	0,01	90 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	84	0,06
40 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig 01.06.2032	38	0,03	50 Wells Fargo & Co, 4,100 %, fällig 03.06.2026	48	0,04
40 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	33	0,03	30 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	28	0,02
40 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	29	0,02	120 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	116	0,09
110 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	96	0,07	60 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	53	0,04
110 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	90	0,07	80 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	75	0,06
120 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	87	0,07	130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	111	0,08
110 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	75	0,06	120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	113	0,09
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15.01.2026	27	0,02	60 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	51	0,04
100 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	78	0,06	20 Wells Fargo & Co, 4,650 %, fällig 04.11.2044	17	0,01
160 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	126	0,10	50 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	44	0,03
50 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	45	0,03	430 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	353	0,27
50 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	45	0,03	200 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	172	0,13
390 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	299	0,23	630 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	581	0,44
100 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	95	0,07	40 Workday Inc, 3,500 %, fällig 01.04.2027	37	0,03
100 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	111	0,08	60 Workday Inc, 3,700 %, fällig 01.04.2029	55	0,04
130 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	128	0,10	30 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	32	0,02
2 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	24	0,02			
2 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	2	–			
170 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	144	0,11	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen	34.151	25,89
50 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	43	0,03	(Anschaffungskosten 56.488 \$)	49.145	37,25
70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	57	0,04	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 21,89 % (28. Februar 2022: 24,00 %)		
80 Texas Instruments Inc, 4,150 %, fällig 15.05.2048	71	0,05	Chile – 0,12 % (28. Februar 2022: 0,40 %)		
170 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050	111	0,08	250 Internationale Anleihe der chilenischen Regierung, 3,100 %, fällig 22.01.2061	156	0,12
30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	29	0,02	Kolumbien – 0,48 % (28. Februar 2022: 0,47 %)		
100 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	88	0,07	220 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 3,125 %, fällig 15.04.2031	160	0,12
130 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	125	0,09	260 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 3,250 %, fällig 22.04.2032	185	0,14
20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	19	0,01	400 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 5,625 %, fällig 26.02.2044	290	0,22
190 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	172	0,13			
80 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	65	0,05			
100 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	78	0,06			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Indien – 0,14 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
200 Export-Import Bank of India, 3,375 %, fällig 05.08.2026	186	0,14			
Israel – 0,54 % (28. Februar 2022: 0,35 %)					
800 Internationale Anleihe der israelischen Regierung, 2,750 %, fällig 03.07.2030	708	0,54			
Kasachstan – 0,14 % (28. Februar 2022 0,09 %)					
200 Internationale Anleihe der kasachischen Regierung, 4,875 %, fällig 14.10.2044	181	0,14			
Mexiko – 0,83 % (28. Februar 2022: 0,65 %)					
940 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,750 %, fällig 08.03.2044	782	0,59			
420 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,400 %, fällig 12.02.2052	320	0,24			
	1.102	0,83			
Panama – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,45 %)					
370 Internationale Anleihe der panamaischen Regierung, 4,300 %, fällig 29.04.2053	268	0,20			
Peru – 0,13 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
40 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 3,550 %, fällig 10.03.2051	28	0,02			
210 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 3,600 %, fällig 15.01.2072	137	0,11			
	165	0,13			
Südkorea – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
270 Korea Housing Finance Corp, 144A, 4,625 %, fällig 24.02.2033	266	0,20			
USA – 18,58 % (28. Februar 2022: 18,21 %)					
1.290 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.03.2023	1.286	0,97			
2.050 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 18.04.2023	2.037	1,54			
750 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β	721	0,55			
20 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 30.04.2024	19	0,02			
70 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2026	66	0,05			
1.490 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	1.483	1,12			
5.770 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2027	5.686	4,31			
900 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	873	0,66			
630 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	573	0,43			
900 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	914	0,69			
170 United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042	150	0,11			
1.370 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	1.351	1,02			
320 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	310	0,24			
110 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.08.2045	90	0,07			
640 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	534	0,40			
3.870 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	2.620	1,99			
1.030 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	591	0,45			
850 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	521	0,40			
280 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	200	0,15			
1.860 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	1.524	1,16			
3.450 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	2.901	2,20			
60 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	61	0,05			
	24.511	18,58			
Uruguay – 0,53 % (28. Februar 2022: 0,38 %)					
80 Internationale Anleihe der uruguayischen Regierung, 4,375 %, fällig 23.01.2031	78	0,06			
300 Internationale Anleihe der uruguayischen Regierung, 5,750 %, fällig 28.10.2034	323	0,25			
300 Internationale Anleihe der uruguayischen Regierung, 5,100 %, fällig 18.06.2050	294	0,22			
	695	0,53			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 32.962 \$)					
	28.873	21,89			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,32 % (28. Februar 2022: 2,35 %)					
1.741 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.741	1,32			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.741 \$)					
	1.741	1,32			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 156.010 \$)					
	140.166	106,25			
Kontrakte					
Gekaufte Optionen – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 96.00, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	55	0,04			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	9	0,01			
	64	0,05			
Summe der gekauften Optionen (Anschaffungskosten 60 \$)					
	64	0,05			
Credit Default Swaps – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,21 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	304	0,23			
Index-Swaps – 1,66 % (28. Februar 2022: 0,68 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.192	1,66			
Zinsswaps – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,12 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	38	0,03			
Futures – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	303	0,23			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	143.067	108,45			
Verkaufte Optionen – (0,05 %) (28. Februar 2022: -0,10 %)					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 95.3750, fällig 15.12.2023 – Goldman Sachs	-52	-0,04			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 118.00, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	-	-			
– U.S. 10 Year April 2023 Put 110.00, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	-4	-			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.25, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	-3	-			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 110.00, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	-	-			
– U.S. 5 Year April 2023 Put 107.75, fällig 24.03.2023 – Goldman Sachs	-11	-0,01			
	-70	-0,05			
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -63 \$)					
	-70	-0,05			
Credit Default Swaps – -0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-44	-0,03			
Index-Swaps – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2	-			
Futures – -0,14 % (28. Februar 2022: -0,65 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-180	-0,14			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	-296	-0,22			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
	142.771	108,23			
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten					
	-10.852	-8,23			
Gesamtvermögen					
	131.919 \$	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	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 24.299.000 USD und machten 18,40 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.				
†	Nicht liquide.				
∞	Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.				
ε	Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2023 in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).				
±	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 2023.				
ABKÜRZUNGEN:					
Ewig	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.				
TBA	– To be announced.				
Verteilung des Gesamtvermögens					
					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					93,71
Organismen für gemeinsame Anlagen					1,18
Finanzderivate					1,96
Sonstige Vermögenswerte					3,15
Gesamtvermögen					100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2027	29.233	\$ 304
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2032	3.880	\$ -44
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 489 \$)				\$ 304
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ -44
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 489 \$)				\$ 260

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,150 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Mai 2048	1.089	\$ 38
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 288 \$)				\$ 38
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -329 \$)				\$ -
Nettowertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -41 \$)				\$ 38

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitstermin	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	2.084	\$ 282
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	2.574	\$ 337
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Mai 2047	1.390	\$ 397
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2047	153	\$ 43
Goldman Sachs	Pay Fixed 1,729 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	1.315	\$ 353
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18. März 2032	1.215	\$ 154
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	559	\$ 79
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	892	\$ 127
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	952	\$ 119
Goldman Sachs	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	2.092	\$ 111
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	6.140	\$ 190
Goldman Sachs	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	30. Juni 2029	1.668	\$ -2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.592 \$)				\$ 2.192
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ -2
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.592 \$)				\$ 2.190

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Goldman Sachs	-132	\$ -31.268	\$ 272
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Goldman Sachs	-53	-12.744	22
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Goldman Sachs	14	3.381	8
3 Month SOFR Index Juni 2023	Goldman Sachs	1	237	-5
3 Month SOFR Index September 2023	Goldman Sachs	12	2.838	-20
90 Day Euro\$ März 2023	Goldman Sachs	19	4.509	-7
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	4	447	1
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	3	611	-1
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	311	33.294	-81
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	14	1.753	-4
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	63	8.509	-62
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 726 \$)			\$ 303	
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.522 \$)			\$ -180	
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -796 \$)			\$ 123	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 6,51 % (28. Februar 2022: 9,12 %)			1.184 Structured Asset Investment Loan Trust 2005-HE1, Series 2005 HE1, Class M2, 5,337 %, fällig 25.07.2035 *		
122 Aegis Asset Backed Sec Corp Mort Pass Thr Certs Series 2003-3, Series 2003 3, Class M2, 7,092 %, fällig 25.01.2034 *	113	0,01	1.108	1.108	0,10
3.060 Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2005-R8, Series 2005 R8, Class M4, 5,487 %, fällig 25.10.2035 *	2.944	0,26	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 80.172 \$)		
2.059 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2I, 144A, 4,194 %, fällig 05.06.2049	2.005	0,18	74.716	74.716	6,51
2.859 Asset Backed Securities Corp Home Equity Loan Trust Series RFC 2007-HE1, Series 2007 HE1, Class A4, 3,538 %, fällig 25.12.2036 *	2.764	0,24	Forderungsbesicherte Wertpapiere – 32,48 % (28. Februar 2022: 19,60 %)		
2.390 BankAmerica Manufactured Housing Contract Trust, Series 1996 1, Class B1, 7,875 %, fällig 10.10.2026	80	0,01	57 Alternative Loan Trust 2005-14, Series 2005 14, Class 2A2, 4,867 %, fällig 25.05.2035 *	43	–
1.500 BCRED MML CLO 2021-1 LLC, Series 2021 1A, Class A, 144A, 6,272 %, fällig 15.01.2035 *	1.465	0,13	197 Alternative Loan Trust 2005-56, Series 2005 56, Class 4A1, 5,237 %, fällig 25.11.2035 *	174	0,02
1.630 BCRED MML CLO 2022-1 LLC, Series 2022 1A, Class A1, 144A, 6,289 %, fällig 20.04.2035 *	1.563	0,14	38 Alternative Loan Trust 2006-18CB, Series 2006 18CB, Class A6, 10,132 %, fällig 25.07.2036 *	34	–
1.740 Cayuga Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class AR, 144A, 5,912 %, fällig 17.07.2034 *	1.711	0,15	3.660 AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 6,806 %, fällig 17.06.2039 *	3.664	0,32
15 ContiMortgage Home Equity Loan Trust 1999-1, Series 1999 1, Class B, 9,000 %, fällig 25.04.2030	18	–	1.198 BAML Re-REMIC Trust 2016-RRGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,648 %, fällig 10.08.2045 *	306	0,03
2.701 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2004 3, Class 1A, 5,037 %, fällig 25.08.2034 *	2.543	0,22	2.145 Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2, Class 2A2, 144A, 4,845 %, fällig 26.05.2037 *	1.836	0,16
849 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	685	0,06	780 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	721	0,06
2.922 Educational Funding Co LLC/The, Series 2006 1A, Class A3, 144A, 5,168 %, fällig 25.04.2033 *	2.036	0,18	12.173 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class XA, 0,718 %, fällig 15.09.2060 *	296	0,03
2.672 Encore Credit Receivables Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M5, 5,577 %, fällig 25.10.2035 *	2.458	0,21	1.500 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,657 %, fällig 15.11.2061 *	1.378	0,12
179 Fannie Mae Grantor Trust 2017-T1, Series 2017 T1, Class A, 2,898 %, fällig 25.06.2027	166	0,02	2.570 BBCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class E, 144A, 4,563 %, fällig 10.08.2033 *	2.134	0,19
8.581 Fieldstone Mortgage Investment Trust Series 2005-2, Series 2005 2, Class M3, 5,397 %, fällig 25.12.2035 *	7.246	0,63	261 Bear Stearns Mortgage Funding Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 1A1, 4,777 %, fällig 25.01.2037 *	223	0,02
2.278 First Franklin Mortgage Loan Trust 2006-FF15, Series 2006 FF15, Class A2, 4,737 %, fällig 25.11.2036 *	2.112	0,18	3.100 BXP Trust 2017-CQHP, Series 2017 CQHP, Class A, 144A, 5,438 %, fällig 15.11.2034 *	2.990	0,26
2.060 Ford Credit Floorplan Master Owner Trust A, Series 2018 4, Class A, 4,060 %, fällig 15.11.2030	1.958	0,17	54 CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 1A2, 5,197 %, fällig 25.04.2035 *	48	–
188 Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Series 2017 SR01, Class A3, 3,089 %, fällig 25.11.2027	174	0,02	300 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC27, Series 2015 GC27, Class AS, 3,571 %, fällig 10.02.2048	285	0,02
2.579 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class A, 144A, 1,930 %, fällig 20.07.2048	1.972	0,17	73.652 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 1,001 %, fällig 15.11.2049 *	2.141	0,19
1.890 GSA Home Equity Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M4, 5,667 %, fällig 25.06.2035 *	1.519	0,13	8.968 Citigroup Mortgage Loan Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 2A4, 5,057 %, fällig 25.09.2036 *	2.957	0,26
3.386 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	2.639	0,23	2.403 COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class A1, 144A, 1,665 %, fällig 25.09.2061 *	2.121	0,18
1.408 Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 5,367 %, fällig 25.02.2034 *	1.346	0,12	20 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Class B, 4,762 %, fällig 10.10.2046 *	17	–
2.000 Magnetite XIV-R Ltd, Series 2015 14RA, Class A2, 144A, 5,912 %, fällig 18.10.2031 *	1.976	0,17	10 COMM 2013-CCRE12 Mortgage Trust, Series 2013 CR12, Class C, 5,020 %, fällig 10.10.2046 *	7	–
1.776 Magnolia Finance, 3,114 %, fällig 09.08.2024	1.736	0,15	484 COMM 2013-CCRE6 Mortgage Trust, Series 2013 CR6, Class B, 144A, 3,397 %, fällig 10.03.2046	454	0,04
3.140 MF1 2021-FL6 Ltd, Series 2021 FL6, Class A, 144A, 5,701 %, fällig 16.07.2036 *	3.068	0,27	90 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class B, 4,035 %, fällig 10.02.2048 *	84	0,01
3.552 Mosaic Solar Loan Trust 2021-3, Series 2021 3A, Class B, 144A, 1,920 %, fällig 20.06.2052	2.752	0,24	70 COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class C, 4,297 %, fällig 10.02.2048 *	61	0,01
3.000 National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	445	0,04	1.450 COMM 2015-PC1 Mortgage Trust, Series 2015 PC1, Class A5, 3,902 %, fällig 10.07.2050	1.396	0,12
3.300 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 4,977 %, fällig 26.01.2032 *	2.569	0,22	184 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1M2, 144A, 6,717 %, fällig 25.10.2039 *	184	0,02
2.000 Nelnet Student Loan Trust 2014-2, Series 2014 2A, Class B, 144A, 6,117 %, fällig 25.06.2041 *	1.857	0,16	500 CSAI 2015-C1 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C1, Class AS, 3,791 %, fällig 15.04.2050 *	466	0,04
2.000 Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd, Series 2021 42A, Class A, 144A, 5,892 %, fällig 16.07.2035 *	1.973	0,17	1.050 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class A2, 144A, 3,953 %, fällig 15.09.2037	949	0,08
1.500 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class AR, 144A, 6,012 %, fällig 15.10.2034 *	1.482	0,13	140 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	82	0,01
1.280 Ocean Trails Clo XI, Series 2021 11A, Class A, 144A, 6,028 %, fällig 20.07.2034 *	1.265	0,11	5.170 CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	2.753	0,24
1.171 Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	951	0,08	1.960 CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class M2, 144A, 2,954 %, fällig 25.07.2057 *	1.505	0,13
295 Origen Manufactured Housing Contract Trust 2006-A, Series 2006 A, Class A2, 6,224 %, fällig 15.10.2037 *	270	0,02	2.482 CSMC 2021-NQM8, Series 2021 NQM8, Class A1, 144A, 1,841 %, fällig 25.10.2066 *	2.111	0,18
1.000 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class A, 144A, 5,888 %, fällig 20.07.2034 *	985	0,08	600 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class G, 144A, 9,938 %, fällig 15.07.2032 *	559	0,05
3.188 RASC Series 2007-KS1 Trust, Series 2007 KS1, Class A4, 4,837 %, fällig 25.01.2037 *	3.059	0,27	1.680 DBCG 2017-BBG Mortgage Trust, Series 2017 BBG, Class A, 144A, 5,288 %, fällig 15.06.2034 *	1.660	0,14
1.954 Renaissance Home Equity Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class AV3, 5,557 %, fällig 25.05.2034 *	1.789	0,16	159 Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Class 3AF1, 144A, 4,868 %, fällig 15.04.2036 *	147	0,01
2.010 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A4, 5,097 %, fällig 25.10.2046 *	1.729	0,15	340 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2014 C03, Class 1M2, 7,617 %, fällig 25.07.2024 *	348	0,03
2.821 SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 9,338 %, fällig 15.10.2041 *	3.028	0,26	2.554 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 8,367 %, fällig 25.10.2030 *	2.688	0,23
340 SMB Private Education Loan Trust 2014-A, Series 2014 A, Class A3, 144A, 6,088 %, fällig 15.04.2032 *	339	0,03	560 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 8,867 %, fällig 25.01.2031 *	596	0,05
2 SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2048	474	0,04	12 Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	3	–
390 SMB Private Education Loan Trust, Series 2020 B, Class A1A, 144A, 1,290 %, fällig 15.07.2053	346	0,03	6 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 22, 5,000 %, fällig 25.01.2039	1	–
2.253 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	1.998	0,17	3 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 23, 5,000 %, fällig 25.01.2039 *	1	–
			7 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 27, 5,500 %, fällig 25.01.2039 *	1	–
			6 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 34, 5,000 %, fällig 25.01.2038	1	–
			16 Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	3	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
6	6	–	6.524	169	0,01
149	15	–	56	53	–
40	42	–	1.660	1.566	0,14
60	64	0,01	569	545	0,05
51	3	–	827	790	0,07
156	165	0,01	46	42	–
194	197	0,02	426	379	0,03
1.088	99	0,01	398	344	0,03
168	10	–	234	201	0,02
802	73	0,01	65	56	–
215	17	–	234	195	0,02
633	378	0,03	299	248	0,02
1.700	1.345	0,12	145	120	0,01
714	110	0,01	81	66	0,01
387	64	0,01	1.251	1.038	0,09
2.172	318	0,03	233	192	0,02
1.345	183	0,02	153	127	0,01
2.117	323	0,03	81	67	0,01
2.058	267	0,02	262	216	0,02
244	229	0,02	221	183	0,02
800	735	0,06	246	202	0,02
745	698	0,06	86	72	0,01
481	429	0,04	157	130	0,01
1.750	114	0,01	84	73	0,01
45	44	–	269	232	0,02
66	60	0,01	180	154	0,01
119	124	0,01	90	77	0,01
13	13	–	1.423	1.222	0,11
1	1	–	183	150	0,01
1.307	1.177	0,10	434	373	0,03
830	752	0,07	180	147	0,01
23	23	–	272	233	0,02
23	22	–	374	332	0,03
26	25	–	462	378	0,03
23	22	–	378	309	0,03
7	7	–	94	83	0,01
324	291	0,03	91	80	0,01
817	736	0,06	87	75	0,01
226	204	0,02	92	76	0,01
203	183	0,02	96	79	0,01
78	75	0,01	95	78	0,01
47	46	–	92	75	0,01
20	19	–	746	640	0,06
571	549	0,05	95	81	0,01
			281	240	0,02
			187	172	0,02
			396	373	0,03
			200	205	0,02
			200	205	0,02
			200	206	0,02
			100	103	0,01
			77	68	0,01
			97	81	0,01
			732	606	0,05
			2.044	1.763	0,15
			531	458	0,04
			1.316	1.084	0,09
			2.986	2.452	0,21
			441	362	0,03
			184	151	0,01
			537	464	0,04
			166	152	0,01
			7.554	6.167	0,54
			2.025	1.718	0,15
			956	765	0,07
			128	103	0,01
			182	155	0,01
			93	79	0,01
			59	56	–
			834	682	0,06
			226	188	0,02
			260	231	0,02
			453	373	0,03
			543	464	0,04
			370	317	0,03
			289	258	0,02
			976	923	0,08
			89	87	0,01
			1.670	1.649	0,14
			1.278	1.091	0,10
			676	580	0,05
			199	200	0,02
			791	807	0,07

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
489 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	437	0,04	77 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	72	0,01
738 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	636	0,06	1.409 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	1.264	0,11
1.331 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	1.152	0,10	367 Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, fällig 20.03.2052	329	0,03
5.718 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	4.916	0,43	468 Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, fällig 20.11.2051	420	0,04
203 Freddie Mac Pool 'SD8129', 2,500 %, fällig 01.02.2051	173	0,02	680 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	590	0,05
2.148 Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000 %, fällig 01.05.2051	1.757	0,15	278 Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, fällig 20.03.2052	250	0,02
121 Freddie Mac Pool 'ZA5318', 3,500 %, fällig 01.03.2048	112	0,01	289 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	263	0,02
1.064 Freddie Mac Pool 'ZA6342', 4,500 %, fällig 01.03.2049	1.049	0,09	1.004 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, fällig 20.04.2052	876	0,08
105 Freddie Mac Pool 'ZI7269', 5,000 %, fällig 01.03.2038	105	0,01	573 Ginnie Mae II Pool '786216', 3,500 %, fällig 20.06.2052	516	0,04
169 Freddie Mac Pool 'ZM1278', 3,500 %, fällig 01.06.2046	158	0,01	889 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, fällig 20.10.2045	854	0,07
48 Freddie Mac Pool 'ZM0480', 3,500 %, fällig 01.10.2042	45	–	219 Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20.10.2047	204	0,02
3 Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, fällig 01.12.2034	3	–	171 Ginnie Mae II Pool 'BD0384', 3,500 %, fällig 20.10.2047	160	0,01
5 Freddie Mac Pool 'ZS2059', 5,500 %, fällig 01.04.2038	5	–	91 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	84	0,01
19 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	19	–	100 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20.10.2049	97	0,01
84 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig 01.06.2041	84	0,01	80 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	74	0,01
52 Freddie Mac Pool 'ZS3412', 3,500 %, fällig 01.12.2038	53	–	84 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig 20.01.2050	82	0,01
106 Freddie Mac Pool 'ZS8669', 3,000 %, fällig 01.09.2032	100	0,01	69 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	66	0,01
111 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01.10.2032	105	0,01	334 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	290	0,03
19 Freddie Mac Pool 'ZS8779', 5,000 %, fällig 01.07.2025	19	–	96 Ginnie Mae II Pool 'C11513', 3,000 %, fällig 20.03.2052	85	0,01
566 Freddie Mac Pool 'ZS9316', 3,500 %, fällig 01.01.2038	535	0,05	191 Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, fällig 20.04.2052	168	0,01
247 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig 01.03.2043	231	0,02	155 Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20.06.2044	146	0,01
23 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig 01.02.2044	22	–	42 Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20.03.2045	39	–
340 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	306	0,03	65 Ginnie Mae II Pool 'MA3375', 3,000 %, fällig 20.01.2046	59	0,01
616 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01.04.2033	592	0,05	55 Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20.03.2046	52	–
53 Freddie Mac Reference REMIC R007, Class ZA, 6,000 %, fällig 15.05.2036	54	–	250 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	233	0,02
36 Freddie Mac REMICS 3621, Class SB, 1,642 %, fällig 15.01.2040 *	3	–	134 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	126	0,01
189 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	164	0,01	228 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	213	0,02
413 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	61	0,01	138 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20.07.2046	129	0,01
1.062 Freddie Mac REMICS 5010, Class JL, 2,500 %, fällig 25.09.2050	167	0,01	84 Ginnie Mae II Pool 'MA3937', 3,500 %, fällig 20.09.2046	79	0,01
417 Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	64	0,01	115 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20.11.2046	105	0,01
860 Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	116	0,01	87 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	79	0,01
221 Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	32	–	22 Ginnie Mae II Pool 'MA4381', 3,000 %, fällig 20.04.2047	20	–
1.394 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	221	0,02	1.485 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	1.424	0,12
472 Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	70	0,01	258 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig 20.08.2047	255	0,02
1.277 Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	179	0,02	15 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig 20.11.2047	14	–
1.200 Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	1.090	0,09	591 Ginnie Mae II Pool 'MA4838', 4,000 %, fällig 20.11.2047	567	0,05
728 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class M2, 144A, 6,467 %, fällig 25.02.2050 *	734	0,06	167 Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20.12.2047	151	0,01
1.461 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class M2, 144A, 6,484 %, fällig 25.12.2050 *	1.467	0,13	253 Ginnie Mae II Pool 'MA4901', 4,000 %, fällig 20.12.2047	243	0,02
43 Freddie Mac Strips 334, Class S7, 1,512 %, fällig 15.08.2044 *	4	–	222 Ginnie Mae II Pool 'MA5020', 4,000 %, fällig 20.02.2048	214	0,02
345 Freddie Mac Strips 353, Class S1, 1,412 %, fällig 15.12.2046 *	31	–	165 Ginnie Mae II Pool 'MA5078', 4,000 %, fällig 20.03.2048	158	0,01
1.304 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2015 HQ2, Class B, 12,567 %, fällig 25.05.2025 *	1.331	0,12	213 Ginnie Mae II Pool 'MA5137', 4,000 %, fällig 20.04.2048	204	0,02
30 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	30	–	390 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig 20.04.2048	384	0,03
50 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	50	–	470 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	463	0,04
52 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	48	–	150 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	147	0,01
395 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	374	0,03	294 Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	289	0,03
75 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	70	0,01	169 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	170	0,01
174 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	160	0,01	130 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	126	0,01
381 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	352	0,03	207 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	203	0,02
240 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	222	0,02	194 Ginnie Mae II Pool 'MA5819', 5,000 %, fällig 20.03.2049	195	0,02
1 Ginnie Mae I Pool 'AB9205', 3,000 %, fällig 15.11.2042	1	–	97 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20.04.2049	95	0,01
210 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	194	0,02	324 Ginnie Mae II Pool 'MA6342', 5,000 %, fällig 20.12.2049	325	0,03
17 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig 20.10.2037	18	–	205 Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig 20.01.2050	206	0,02
20 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig 20.01.2040	20	–	181 Ginnie Mae II Pool 'MA6603', 5,000 %, fällig 20.04.2050	182	0,02
23 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig 20.05.2040	23	–	1.591 Ginnie Mae II Pool 'MA6711', 3,500 %, fällig 20.06.2050	1.477	0,13
79 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig 20.07.2040	80	0,01	1.792 Ginnie Mae II Pool 'MA6997', 3,500 %, fällig 20.11.2050	1.672	0,15
15 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig 20.08.2040	15	–	460 Ginnie Mae II Pool 'MA6999', 4,500 %, fällig 20.11.2050	446	0,04
10 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig 20.09.2040	11	–	87 Ginnie Mae II Pool 'MA7056', 4,500 %, fällig 20.12.2050	85	0,01
6 Ginnie Mae II Pool '4871', 6,000 %, fällig 20.11.2040	6	–	327 Ginnie Mae II Pool 'MA7136', 2,500 %, fällig 20.01.2051	285	0,02
20 Ginnie Mae II Pool '4905', 6,000 %, fällig 20.12.2040	21	–	111 Ginnie Mae II Pool 'MA7194', 3,000 %, fällig 20.02.2051	100	0,01
3 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20.01.2041	3	–	144 Ginnie Mae II Pool 'MA7255', 2,500 %, fällig 20.03.2051	125	0,01
12 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	13	–	1.211 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	1.053	0,09
173 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	172	0,02	2.239 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	2.010	0,18
4 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20.07.2040	4	–	3.396 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig 20.02.2052	3.133	0,27
52 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, fällig 20.07.2041	52	–	17.100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	14.794	1,29
110 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	103	0,01	12.600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	11.253	0,98
1.228 Ginnie Mae II Pool '784674', 3,500 %, fällig 20.04.2048	1.154	0,10	2.200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	2.079	0,18
79 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	72	0,01	5.600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	5.431	0,47
442 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	395	0,03	7.700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	7.610	0,66
			3.400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	3.413	0,30
			600 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	609	0,05
			160 Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 5,748 %, fällig 20.11.2059 *	160	0,01
			4 Government National Mortgage Association, Series 2010 42, Class BS, 1,882 %, fällig 20.04.2040 *	–	–
			2 Government National Mortgage Association, Series 2010 85, Class HS, 2,052 %, fällig 20.01.2040 *	–	–
			341 Government National Mortgage Association, Series 2010 H11, Class FA, 5,517 %, fällig 20.06.2060 *	342	0,03
			291 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 4,722 %, fällig 20.10.2060 *	289	0,03
			2 Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 4,742 %, fällig 20.05.2059 *	2	–
			474 Government National Mortgage Association, Series 2010 H24, Class FA, 4,742 %, fällig 20.10.2060 *	472	0,04
			20 Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,742 %, fällig 20.08.2058 *	20	–
			180 Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 4,842 %, fällig 20.11.2060 *	180	0,02

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
37	37	–	1.764	89	0,01
308	278	0,02	200	170	0,01
4.914	7	–	2.881	2.472	0,22
836	18	–	2.183	1.622	0,14
36	34	–	80	79	0,01
217	39	–	867	6	–
1.741	1.731	0,15	16	14	–
484	88	0,01	3.980	783	0,07
806	19	–	4.070	2.509	0,22
203	27	–	1.897	1.828	0,16
789	82	0,01	182	159	0,01
377	76	0,01	30	29	–
938	31	–	160	149	0,01
931	30	–	72	19	–
905	33	–	14	13	–
516	15	–	20	10	–
105	5	–	280	255	0,02
4.162	179	0,02	2.870	2.682	0,23
54	2	–	367	333	0,03
320	316	0,03	698	651	0,06
561	560	0,05	935	814	0,07
296	265	0,02	113	104	0,01
1.478	1.174	0,10	5	4	–
317	44	–	2.694	2.618	0,23
961	133	0,01	690	635	0,06
470	67	0,01	75.481	2.832	0,25
407	59	0,01	1.575	1.522	0,13
16.184	1.057	0,09	178	154	0,01
250	36	–	75	73	0,01
324	46	–	20	19	–
1.402	193	0,02	250	236	0,02
1.518	199	0,02	160	150	0,01
12.344	1.137	0,10	4.856	188	0,02
3.056	331	0,03	2.330	2.035	0,18
807	133	0,01	2.010	1.891	0,16
291	48	–	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 409.159 \$)		
829	824	0,07		373.100	32,48
176	178	0,02	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 36,53 % (28. Februar 2022: 32,53 %)		
99	97	0,01	Australien – 0,04 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
390	378	0,03	300	291	0,03
103	100	0,01	200	171	0,01
953	756	0,07		462	0,04
1.854	1.475	0,13	Belgien – 0,40 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
25.777	1.931	0,17	1.220	1.120	0,10
1.500	1.401	0,12	680	650	0,06

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Belgien – (Fortsetzung)					
280 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	255	0,02	1.000 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	853	0,08
1.610 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	1.416	0,12	480 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	384	0,03
153 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	135	0,01	353 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 6,848 %, fällig 01.12.2027 *	353	0,03
1.060 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	1.068	0,09	50 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2023	50	0,01
	4.644	0,40	120 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024	119	0,01
				4.343	0,38
Brasilien – 0,67 % (28. Februar 2022: 0,73 %)					
57 Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig 17.03.2024	57	0,01	Israel – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,38 %)		
5.150 Petrobras Global Finance BV, 5,299 %, fällig 27.01.2025	5.091	0,44	910 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	901	0,08
290 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	242	0,02	210 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig 15.04.2024	210	0,02
190 Suzano Austria GmbH, 3,750 %, fällig 15.01.2031	161	0,01	590 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	598	0,05
2.050 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	1.617	0,14	1.570 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.373	0,12
60 Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	66	0,01	430 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	387	0,03
410 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	421	0,04	1.530 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	1.356	0,12
	7.655	0,67		4.825	0,42
Kanada – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,17 %)					
120 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	107	0,01	Italien – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,20 %)		
110 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	93	0,01	1.160 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	1.121	0,10
160 Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	143	0,01	850 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	814	0,07
550 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	482	0,04		1.935	0,17
290 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	289	0,03	Japan – 0,37 % (28. Februar 2022: 0,18 %)		
500 Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2043	504	0,05	540 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 3,837 %, fällig 17.04.2026 *	519	0,04
650 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig 02.12.2051	444	0,04	560 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, fällig 19.04.2028 *	532	0,05
30 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	25	–	580 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15.09.2023	570	0,05
40 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2031	32	–	1.810 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025	1.694	0,15
20 Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	20	–	990 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	903	0,08
1.460 Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, fällig 08.06.2032	1.375	0,12		4.218	0,37
390 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	367	0,03	Kasachstan – 0,05 % (28. Februar 2022 0,05 %)		
	3.881	0,34	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 5,750 %, fällig 19.04.2047	160	0,01
China – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,25 %)					
370 NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025	347	0,03	520 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 6,375 %, fällig 24.10.2048	439	0,04
2.650 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	2.036	0,18		599	0,05
1.660 Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08.02.2051	1.008	0,09	Kuwait – 0,04 % (28. Februar 2022: 0,04 %)		
	3.391	0,30	520 Equate Petrochemical BV, 144A, 4,250 %, fällig 03.11.2026	501	0,04
Kolumbien – 0,13 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
1.210 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	903	0,08	Luxemburg – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
960 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	634	0,05	150 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039	153	0,01
	1.537	0,13	Macau – 0,43 % (28. Februar 2022: 0,22 %)		
Dänemark – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,02 %)					
280 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *	266	0,02	2.290 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig 08.08.2025	2.222	0,20
2.040 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	1.924	0,17	710 Sands China Ltd, 2,800 %, fällig 08.03.2027	605	0,05
	2.190	0,19	580 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig 08.08.2028	550	0,05
Frankreich – 1,08 % (28. Februar 2022: 0,53 %)					
700 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	549	0,05	730 Sands China Ltd, 3,350 %, fällig 08.03.2029	597	0,05
280 BNP Paribas SA, 144A, 3,375 %, fällig 09.01.2025	269	0,02	1.090 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	934	0,08
310 BNP Paribas SA, 144A, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	307	0,03		4.908	0,43
1.660 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	1.534	0,13	Mexiko – 0,11 % (28. Februar 2022: 0,09 %)		
620 BNP Paribas SA, 144A, 4,625 %, fällig 13.03.2027	595	0,05	20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01.03.2035	21	–
2.890 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027 *	2.541	0,22	20 America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15.11.2037	21	–
1.580 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	1.493	0,13	1.320 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	1.236	0,11
2.210 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	2.174	0,19		1.278	0,11
360 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	350	0,03	Marokko – 0,12 % (28. Februar 2022: 0,14 %)		
550 BNP Paribas SA, 144A, 4,375 %, fällig 01.03.2033 *	500	0,04	310 OCP SA, 144A, 4,500 %, fällig 22.10.2025	298	0,03
500 BPCE SA, 144A, 5,150 %, fällig 21.07.2024	492	0,04	940 OCP SA, 144A, 3,750 %, fällig 23.06.2031	757	0,06
590 Credit Agricole SA, 144A, 4,000 %, fällig 10.01.2033 *	529	0,05	480 OCP SA, 144A, 5,125 %, fällig 23.06.2051	348	0,03
240 Danone SA, 144A, 2,947 %, fällig 02.11.2026	223	0,02		1.403	0,12
940 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024	897	0,08	Niederlande – 0,45 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
	12.453	1,08	200 ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,750 %, fällig 28.07.2025	195	0,02
Indien – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,10 %)					
330 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 12.01.2032	268	0,02	1.840 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	1.783	0,15
1.270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12.01.2052	891	0,08	250 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 1,339 %, fällig 24.06.2026 *	226	0,02
	1.159	0,10	600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	560	0,05
Irland – 0,38 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
850 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,150 %, fällig 15.02.2024	829	0,07	600 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, fällig 06.04.2033 *	522	0,05
1.990 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	1.755	0,15	160 Shell International Finance BV, 4,550 %, fällig 12.08.2043	146	0,01
			770 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	682	0,06
			270 Shell International Finance BV, 4,000 %, fällig 10.05.2046	225	0,02
			1.170 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	861	0,07
				5.200	0,45

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			110 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	92	0,01
Südafrika – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,08 %)			30 ADT Security Corp/The, 144A, 4,125 %, fällig 01.08.2029	26	–
670 Anglo American Capital Plc, 144A, 3,625 %, fällig 11.09.2024	648	0,06	90 Aetna Inc, 2,800 %, fällig 15.06.2023	89	0,01
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	0,02	450 Air Lease Corp, 3,375 %, fällig 01.07.2025	425	0,04
290 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,000 %, fällig 11.09.2027	272	0,02	600 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	583	0,05
	1.114	0,10	160 Alphabet Inc, 0,450 %, fällig 15.08.2025	145	0,01
Spanien – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			370 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	292	0,03
1.200 Banco Santander SA, 2,746 %, fällig 28.05.2025	1.125	0,10	370 Alphabet Inc, 1,900 %, fällig 15.08.2040	247	0,02
200 Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028 *	187	0,02	230 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	139	0,01
500 Telefonica Emisiones SA, 4,103 %, fällig 08.03.2027	474	0,04	210 Amazon.com Inc, 3,300 %, fällig 13.04.2027	198	0,02
210 Telefonica Emisiones SA, 5,213 %, fällig 08.03.2047	177	0,01	970 Amazon.com Inc, 1,200 %, fällig 03.06.2027	838	0,07
260 Telefonica Emisiones SA, 4,895 %, fällig 06.03.2048	207	0,02	660 Amazon.com Inc, 3,150 %, fällig 22.08.2027	617	0,05
	2.170	0,19	430 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	400	0,04
Schweiz – 1,28 % (28. Februar 2022: 0,47 %)			510 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	409	0,04
1.570 Credit Suisse AG/New York NY, 7,950 %, fällig 09.01.2025	1.586	0,14	260 Amazon.com Inc, 2,100 %, fällig 12.05.2031	214	0,02
710 Credit Suisse AG/New York NY, 2,950 %, fällig 09.04.2025	645	0,06	1.750 Amazon.com Inc, 3,600 %, fällig 13.04.2032	1.603	0,14
1.530 Credit Suisse AG/New York NY, 5,000 %, fällig 09.07.2027	1.403	0,12	2.240 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	1.981	0,17
1.640 Credit Suisse AG/New York NY, 7,500 %, fällig 15.02.2028	1.657	0,14	340 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	334	0,03
700 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,593 %, fällig 11.09.2025 *	635	0,05	320 Amazon.com Inc, 4,050 %, fällig 22.08.2047	277	0,02
610 Credit Suisse Group AG, 144A, 2,193 %, fällig 05.06.2026 *	526	0,05	1.230 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	791	0,07
670 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	532	0,05	140 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	121	0,01
720 Credit Suisse Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	507	0,04	640 American Express Co, 3,375 %, fällig 03.05.2024	626	0,05
420 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, fällig 15.11.2033 *	442	0,04	1.000 American Express Co, 4,050 %, fällig 03.05.2029	948	0,08
2.840 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Ewige Anleihe *†c	2.577	0,22	246 American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025	232	0,02
200 UBS AG/London, 144A, 4,500 %, fällig 26.06.2048	178	0,02	220 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	180	0,02
270 UBS Group AG, 144A, 4,488 %, fällig 12.05.2026 *	263	0,02	34 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	29	–
820 UBS Group AG, 144A, 4,253 %, fällig 23.03.2028	774	0,07	270 Apache Corp, 7,750 %, fällig 15.12.2029	280	0,02
680 UBS Group AG, 144A, 4,751 %, fällig 12.05.2028 *	655	0,06	17 Apache Corp, 6,000 %, fällig 15.01.2037	16	–
300 UBS Group AG, 144A, 2,746 %, fällig 11.02.2033 *	236	0,02	1.160 Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040	956	0,08
2.090 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe *	2.085	0,18	60 Apache Corp, 5,250 %, fällig 01.02.2042	49	–
	14.701	1,28	510 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	391	0,03
Vereinigte Arabische Emirate – 0,08 % (28. Februar 2022: 0,07 %)			180 Apache Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2044	130	0,01
200 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	194	0,02	290 Apache Corp, 5,350 %, fällig 01.07.2049	230	0,02
760 DP World Ltd/United Arab Emirates, 5,625 %, fällig 25.09.2048	736	0,06	720 Apple Inc, 2,450 %, fällig 04.08.2026	667	0,06
	930	0,08	250 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029	201	0,02
Vereinigtes Königreich – 1,05 % (28. Februar 2022: 0,73 %)			400 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	380	0,03
410 Barclays Plc, 4,972 %, fällig 16.05.2029 *	391	0,03	1.300 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	1.159	0,10
2.610 Barclays Plc, 5,088 %, fällig 20.06.2030 *	2.420	0,21	510 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	434	0,04
430 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	415	0,04	150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	117	0,01
330 HSBC Holdings Plc, 4,300 %, fällig 08.03.2026	319	0,03	390 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	299	0,03
600 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	561	0,05	170 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	163	0,01
400 HSBC Holdings Plc, 4,583 %, fällig 19.06.2029 *	376	0,03	190 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	185	0,02
950 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, fällig 29.03.2033 *	854	0,07	161 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	131	0,01
340 HSBC Holdings Plc, 6,500 %, fällig 02.05.2036	352	0,03	1.218 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	1.003	0,09
820 Lloyds Banking Group Plc, 4,650 %, fällig 24.03.2026	791	0,07	919 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	632	0,06
780 Lloyds Banking Group Plc, 4,375 %, fällig 22.03.2028	738	0,06	689 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	467	0,04
2.560 NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	2.538	0,22	70 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	49	–
630 NatWest Group Plc, 4,269 %, fällig 22.03.2025 *	619	0,05	465 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	315	0,03
230 NatWest Group Plc, 4,892 %, fällig 18.05.2029 *	220	0,02	530 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	425	0,04
250 NatWest Group Plc, 5,076 %, fällig 27.01.2030 *	240	0,02	680 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	680	0,06
420 Standard Chartered Plc, 144A, 5,700 %, fällig 26.03.2044	396	0,04	520 Bank of America Corp, 4,200 %, fällig 26.08.2024	510	0,04
340 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	308	0,03	470 Bank of America Corp, 4,000 %, fällig 22.01.2025	458	0,04
630 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	522	0,05	130 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	126	0,01
	12.060	1,05	830 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	791	0,07
USA – 27,97 % (28. Februar 2022: 26,22 %)			1.510 Bank of America Corp, 1,319 %, fällig 19.06.2026 *	1.370	0,12
470 3M Co, 2,375 %, fällig 26.08.2029	395	0,03	970 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	932	0,08
130 3M Co, 3,050 %, fällig 15.04.2030	114	0,01	1.600 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig 27.04.2028 *	1.530	0,13
920 3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	714	0,06	940 Bank of America Corp, 3,593 %, fällig 21.07.2028 *	867	0,08
230 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	229	0,02	1.770 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	1.612	0,14
420 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	413	0,04	3.040 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	2.824	0,25
140 AbbVie Inc, 3,750 %, fällig 14.11.2023	138	0,01	1.800 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	1.648	0,14
2.150 AbbVie Inc, 2,600 %, fällig 21.11.2024	2.051	0,18	1.500 Bank of America Corp, 2,884 %, fällig 22.10.2030 *	1.269	0,11
590 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	573	0,05	3.090 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	2.462	0,21
250 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	241	0,02	1.870 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	1.531	0,13
520 AbbVie Inc, 2,950 %, fällig 21.11.2026	480	0,04	560 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	472	0,04
4.280 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	3.787	0,33	2.260 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	1.818	0,16
7 AbbVie Inc, 4,750 %, fällig 15.03.2045	6	–	380 Bank of New York Mellon Corp/The, 1,600 %, fällig 24.04.2025	352	0,03
90 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	83	0,01	30 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.11.2025	26	–
			435 Becton Dickinson and Co, 3,363 %, fällig 06.06.2024	424	0,04
			26 Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	25	–
			487 Becton Dickinson and Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	433	0,04
			600 Becton Dickinson and Co, 4,669 %, fällig 06.06.2047	528	0,05
			1.330 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	1.185	0,10
			3.560 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	3.060	0,27
			330 BP Capital Markets America Inc, 3,410 %, fällig 11.02.2026	315	0,03
			1.150 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	1.087	0,09
			440 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	403	0,04
			900 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	611	0,05
			43 Brighthouse Financial Inc, 4,700 %, fällig 22.06.2047	34	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
532 Bristol-Myers Squibb Co, 3,200 %, fällig 15.06.2026	504	0,04	1.456 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	1.847	0,16
705 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	647	0,06	255 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	240	0,02
2.120 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	1.564	0,14	100 Citigroup Inc, Series O, 8,870 %, Ewige Anleihe *	101	0,01
110 Builders FirstSource Inc, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2032	92	0,01	390 Citigroup Inc, Series P, 5,950 %, Ewige Anleihe *	382	0,03
630 Cameron LNG LLC, 144A, 2,902 %, fällig 15.07.2031	547	0,05	90 Citigroup Inc, Series M, 6,300 %, Ewige Anleihe *	88	0,01
850 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	709	0,06	720 Coca-Cola Co/The, 3,375 %, fällig 25.03.2027	688	0,06
30 Carrier Global Corp, 2,700 %, fällig 15.02.2031	25	–	670 Coca-Cola Co/The, 1,450 %, fällig 01.06.2027	589	0,05
50 Carrier Global Corp, 3,577 %, fällig 05.04.2050	36	–	20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	15	–
70 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.08.2030	58	0,01	280 Coca-Cola Co/The, 2,600 %, fällig 01.06.2050	188	0,02
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	300	0,03	130 Comcast Corp, 3,950 %, fällig 15.10.2025	126	0,01
1.870 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.482	0,13	640 Comcast Corp, 3,150 %, fällig 01.03.2026	605	0,05
360 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	333	0,03	280 Comcast Corp, 3,300 %, fällig 01.04.2027	263	0,02
520 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	476	0,04	2.140 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	2.047	0,18
290 Centene Corp, 3,375 %, fällig 15.02.2030	245	0,02	390 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	352	0,03
50 Centene Corp, 3,000 %, fällig 15.10.2030	41	–	840 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	798	0,07
60 Centene Corp, 2,625 %, fällig 01.08.2031	47	–	60 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2033	56	0,01
1.760 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	1.723	0,15	60 Comcast Corp, 5,650 %, fällig 15.06.2035	62	0,01
1.550 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	1.426	0,12	13 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	14	–
1.200 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	1.121	0,10	1.540 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	1.322	0,12
500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	428	0,04	400 Comcast Corp, 3,250 %, fällig 01.11.2039	312	0,03
500 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	419	0,04	300 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	246	0,02
270 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	174	0,02	80 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 15.07.2046	59	0,01
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	236	0,02	120 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 15.08.2047	98	0,01
70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	56	0,01	224 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	181	0,02
1.000 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	836	0,07	110 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	89	0,01
240 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	185	0,02	293 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	236	0,02
210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	154	0,01	200 Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	147	0,01
440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063	342	0,03	400 Comcast Corp, 2,800 %, fällig 15.01.2051	256	0,02
400 Cheniere Energy Inc, 4,625 %, fällig 15.10.2028	371	0,03	619 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	401	0,04
130 Cheniere Energy Partners LP, 4,000 %, fällig 01.03.2031	112	0,01	66 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	53	–
690 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	554	0,05	477 Comcast Corp, 2,937 %, fällig 01.11.2056	300	0,03
340 Chevron Corp, 2,954 %, fällig 16.05.2026	320	0,03	100 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	93	0,01
240 Chevron Corp, 1,995 %, fällig 11.05.2027	215	0,02	74 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	45	–
80 Chevron Corp, 3,078 %, fällig 11.05.2050	58	0,01	20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	17	–
950 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	914	0,08	300 CommScope Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2026	289	0,03
140 Chubb INA Holdings Inc, 3,350 %, fällig 03.05.2026	133	0,01	130 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	106	0,01
232 Cigna Group/The, 3,750 %, fällig 15.07.2023	230	0,02	85 ConocoPhillips Co, 6,950 %, fällig 15.04.2029	93	0,01
290 Cigna Group/The, 4,125 %, fällig 15.11.2025	282	0,02	240 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	215	0,02
3.510 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	3.372	0,29	190 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	150	0,01
110 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	99	0,01	330 Constellation Brands Inc, 3,600 %, fällig 09.05.2024	323	0,03
90 Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	63	0,01	640 Constellation Brands Inc, 4,750 %, fällig 15.11.2024	635	0,06
270 Cintas Corp No 2, 3,700 %, fällig 01.04.2027	258	0,02	450 Constellation Brands Inc, 4,350 %, fällig 09.05.2027	435	0,04
300 Cintas Corp No 2, 4,000 %, fällig 01.05.2032	279	0,02	300 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig 15.04.2023	300	0,03
250 Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2023	249	0,02	130 Continental Resources Inc/OK, 3,800 %, fällig 01.06.2024	127	0,01
680 Citigroup Inc, 1,678 %, fällig 15.05.2024 *	674	0,06	290 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig 15.11.2026	253	0,02
330 Citigroup Inc, 3,300 %, fällig 27.04.2025	316	0,03	1.160 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	1.075	0,09
440 Citigroup Inc, 4,400 %, fällig 10.06.2025	431	0,04	390 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	369	0,03
220 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	221	0,02	100 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	75	0,01
490 Citigroup Inc, 3,106 %, fällig 08.04.2026 *	466	0,04	1.020 Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	892	0,08
110 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	106	0,01	340 Costco Wholesale Corp, 1,600 %, fällig 20.04.2030	278	0,02
2.130 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	2.036	0,18	1.790 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	1.679	0,15
450 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	435	0,04	560 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	518	0,05
60 Citigroup Inc, 4,125 %, fällig 25.07.2028	56	0,01	300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	217	0,02
1.360 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	1.246	0,11	200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	137	0,01
1.750 Citigroup Inc, 4,075 %, fällig 23.04.2029 *	1.630	0,14	510 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	363	0,03
2.300 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	2.099	0,18	130 CTR Partnership LP / CareTrust Capital Corp, 144A, 3,875 %, fällig 30.06.2028	111	0,01
1.590 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	1.479	0,13	761 CVS Health Corp, 3,875 %, fällig 20.07.2025	738	0,06
1.680 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03.11.2032 *	1.327	0,12	220 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	207	0,02
1.150 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	1.001	0,09	268 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	256	0,02
540 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	512	0,04	530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	479	0,04
			160 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	124	0,01
			410 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	322	0,03
			400 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	364	0,03
			220 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	181	0,02
			440 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	398	0,03
			3.800 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	3.413	0,30
			70 CVS Health Corp, 4,250 %, fällig 01.04.2050	56	0,01
			13 CVS Pass-Through Trust, 144A, 5,298 %, fällig 11.01.2027	12	–
			16 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 10.12.2028	16	–
			29 CVS Pass-Through Trust, 6,943 %, fällig 10.01.2030	30	–
			150 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	153	0,01
			140 Deere & Co, 3,100 %, fällig 15.04.2030	125	0,01
			740 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	632	0,06
			190 Delta Air Lines Inc, 3,800 %, fällig 19.04.2023	189	0,02
			410 Delta Air Lines Inc, 2,900 %, fällig 28.10.2024	390	0,03
			3.130 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	3.196	0,28
			810 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	834	0,07
			330 Devon Energy Corp, 8,250 %, fällig 01.08.2023	332	0,03
			530 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	534	0,05
			260 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	242	0,02
			40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	37	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
520 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	433	0,04	720 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	698	0,06
1.950 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	1.654	0,14	1.390 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	1.262	0,11
50 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	46	–	1.970 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	1.851	0,16
660 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	583	0,05	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	251	0,02
480 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	373	0,03	4.750 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	4.363	0,38
450 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	422	0,04	2.650 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	2.483	0,22
410 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	319	0,03	3.730 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	2.976	0,26
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	193	0,02	670 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	718	0,06
40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	32	–	160 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,210 %, fällig 22.04.2042 *	116	0,01
170 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	101	0,01	380 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,908 %, fällig 21.07.2042 *	262	0,02
130 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	127	0,01	560 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	520	0,05
640 Duke Energy Ohio Inc, 3,650 %, fällig 01.02.2029	592	0,05	540 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	484	0,04
420 Eaton Corp, 4,150 %, fällig 02.11.2042	358	0,03	580 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,375 %, fällig 24.03.2027	540	0,05
36 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	41	–	410 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,375 %, fällig 24.03.2029	365	0,03
200 Elevance Health Inc, 3,350 %, fällig 01.12.2024	194	0,02	620 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	542	0,05
730 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	685	0,06	100 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	86	0,01
840 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	772	0,07	11 Halliburton Co, 3,800 %, fällig 15.11.2025	11	–
360 Elevance Health Inc, 4,550 %, fällig 15.05.2052	312	0,03	60 Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15.11.2035	56	0,01
1.080 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	1.022	0,09	320 Halliburton Co, 5,000 %, fällig 15.11.2045	283	0,02
510 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	437	0,04	50 Hanesbrands Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.05.2024	50	–
2.150 Enterprise Products Operating LLC, 4,200 %, fällig 31.01.2050	1.729	0,15	200 Hanesbrands Inc, 144A, 4,875 %, fällig 15.05.2026	185	0,02
420 Enterprise Products Operating LLC, 3,700 %, fällig 31.01.2051	310	0,03	70 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	65	0,01
90 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	66	0,01	100 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	99	0,01
220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	184	0,02	270 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.02.2025	268	0,02
240 EOG Resources Inc, 4,150 %, fällig 15.01.2026	234	0,02	10 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.04.2025	10	–
190 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	183	0,02	170 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	167	0,01
690 EOG Resources Inc, 3,900 %, fällig 01.04.2035	610	0,05	30 HCA Inc, 5,375 %, fällig 01.09.2026	30	–
180 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	173	0,02	90 HCA Inc, 5,625 %, fällig 01.09.2028	89	0,01
50 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	50	–	660 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	660	0,06
20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	18	–	1.040 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	895	0,08
1.450 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	1.327	0,12	400 HCA Inc, 5,500 %, fällig 15.06.2047	360	0,03
200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	187	0,02	180 Hershey Co/The, 0,900 %, fällig 01.06.2025	164	0,01
420 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	353	0,03	200 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.05.2028	194	0,02
60 Exxon Mobil Corp, 1,571 %, fällig 15.04.2023	60	0,01	380 Home Depot Inc/The, 2,500 %, fällig 15.04.2027	348	0,03
180 Exxon Mobil Corp, 3,043 %, fällig 01.03.2026	171	0,02	70 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 06.12.2028	67	0,01
650 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	603	0,05	440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	381	0,03
1.130 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	966	0,08	490 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	391	0,03
80 Exxon Mobil Corp, 4,327 %, fällig 19.03.2050	71	0,01	90 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	75	0,01
270 FirstEnergy Corp, Series A, 1,600 %, fällig 15.01.2026	241	0,02	1.370 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	1.018	0,09
3.460 FirstEnergy Corp, Series B, 4,150 %, fällig 15.07.2027	3.231	0,28	430 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	411	0,04
1.000 FirstEnergy Corp, Series C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	893	0,08	1.700 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	1.484	0,13
770 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	585	0,05	190 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	147	0,01
570 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	531	0,05	70 Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	61	–
150 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15.01.2043	110	0,01	20 Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	18	0,01
400 Ford Motor Credit Co LLC, 5,125 %, fällig 16.06.2025	387	0,03	50 ILCF E-Capital Trust II, 144A, 6,538 %, fällig 21.12.2065 *	36	–
1.390 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	1.297	0,11	410 Intel Corp, 1,600 %, fällig 12.08.2028	345	0,03
600 Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig 17.08.2027	535	0,05	430 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	425	0,04
610 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 04.11.2027	620	0,05	130 Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	96	0,01
260 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16.02.2028	217	0,02	380 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	330	0,03
200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	163	0,01	200 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	128	0,01
810 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03.05.2029	741	0,06	1.660 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	1.585	0,14
890 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	743	0,06	210 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	199	0,02
500 Ford Motor Credit Co LLC, 3,625 %, fällig 17.06.2031	397	0,03	1.940 International Business Machines Corp, 3,000 %, fällig 15.05.2024	1.887	0,16
10 Freeport-McMoRan Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2023	10	–	1.040 Johnson & Johnson, 3,625 %, fällig 03.03.2037	919	0,08
30 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	29	–	1.420 JPMorgan Chase & Co, 1,514 %, fällig 01.06.2024 *	1.406	0,12
260 Freeport-McMoRan Inc, 4,625 %, fällig 01.08.2030	240	0,02	250 JPMorgan Chase & Co, 3,875 %, fällig 10.09.2024	244	0,02
240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	226	0,02	1.400 JPMorgan Chase & Co, 4,023 %, fällig 05.12.2024 *	1.382	0,12
1.170 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.058	0,09	1.160 JPMorgan Chase & Co, 2,083 %, fällig 22.04.2026 *	1.078	0,09
440 General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	445	0,04	1.000 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	915	0,08
210 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	200	0,02	770 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	722	0,06
50 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	50	–	780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	739	0,06
50 General Motors Co, 5,150 %, fällig 01.04.2038	43	–	640 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	530	0,05
230 General Motors Co, 6,250 %, fällig 02.10.2043	217	0,02	2.050 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	1.640	0,14
330 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	297	0,03	1.730 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	1.593	0,14
10 General Motors Financial Co Inc, 4,250 %, fällig 15.05.2023	10	–	300 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	205	0,02
50 General Motors Financial Co Inc, 4,350 %, fällig 17.01.2027	48	–	380 Kinder Morgan Energy Partners LP, 3,500 %, fällig 01.09.2023	377	0,03
200 Gilead Sciences Inc, 3,500 %, fällig 01.02.2025	194	0,02	110 Kinder Morgan Energy Partners LP, 4,250 %, fällig 01.09.2024	108	0,01
250 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	226	0,02	300 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.06.2025	293	0,03
10 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,250 %, fällig 01.06.2025	10	–			
80 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 5,375 %, fällig 15.04.2026	78	0,01			
3 Goldman Sachs Capital II, 5,730 %, Ewige Anleihe *	2	–			
800 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,850 %, fällig 08.07.2024	783	0,07			
760 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	732	0,06			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
520 Kinder Morgan Inc, 4,300 %, fällig 01.03.2028	496	0,04	260 Occidental Petroleum Corp, 4,200 %, fällig 15.03.2048	199	0,02
270 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	254	0,02	1.000 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.08.2049	775	0,07
580 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	525	0,05	1.160 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	1.037	0,09
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	52	–	90 Oracle Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2030	77	0,01
30 KKR Group Finance Co II LLC, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2043	28	–	430 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	408	0,04
130 Kraft Heinz Foods Co, 3,000 %, fällig 01.06.2026	121	0,01	1.690 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	1.402	0,12
150 Kraft Heinz Foods Co, 4,250 %, fällig 01.03.2031	141	0,01	300 Otis Worldwide Corp, 2,056 %, fällig 05.04.2025	280	0,02
20 Kraft Heinz Foods Co, 6,750 %, fällig 15.03.2032	22	–	310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	264	0,02
80 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 15.07.2035	77	0,01	390 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	304	0,03
50 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26.01.2039	55	–	80 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	54	–
10 Kraft Heinz Foods Co, 144A, 7,125 %, fällig 01.08.2039	11	–	190 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	120	0,01
10 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 01.10.2039	9	–	90 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	82	0,01
170 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	155	0,01	560 PayPal Holdings Inc, 1,650 %, fällig 01.06.2025	519	0,05
520 Kraft Heinz Foods Co, 5,200 %, fällig 15.07.2045	480	0,04	70 PepsiCo Inc, 2,625 %, fällig 19.03.2027	65	0,01
210 Kraft Heinz Foods Co, 4,375 %, fällig 01.06.2046	172	0,02	580 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	472	0,04
370 Kraft Heinz Foods Co, 4,875 %, fällig 01.10.2049	327	0,03	220 PepsiCo Inc, 2,875 %, fällig 15.10.2049	159	0,01
300 Kraft Heinz Foods Co, 5,500 %, fällig 01.06.2050	288	0,03	620 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	541	0,05
2.770 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	2.667	0,23	580 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	475	0,04
1.320 Las Vegas Sands Corp, 2,900 %, fällig 25.06.2025	1.224	0,11	170 Pioneer Natural Resources Co, 1,125 %, fällig 15.01.2026	151	0,01
160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Nullkupon, Ewige Anleihe [†] 00%	–	–	270 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	211	0,02
79 Lehman Swap Receipt, Nullkupon, Ewige Anleihe [†] 00%	–	–	1.000 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	789	0,07
120 Lennar Corp, 4,500 %, fällig 30.04.2024	118	0,01	250 PNC Bank NA, 3,875 %, fällig 10.04.2025	242	0,02
50 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 30.05.2025	49	–	240 Principal Life Global Funding II, 144A, 1,250 %, fällig 23.06.2025	218	0,02
460 Lennar Corp, 4,750 %, fällig 29.11.2027	441	0,04	120 Procter & Gamble Co/The, 2,800 %, fällig 25.03.2027	112	0,01
280 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	267	0,02	340 Procter & Gamble Co/The, 3,000 %, fällig 25.03.2030	309	0,03
540 Mars Inc, 144A, 3,200 %, fällig 01.04.2030	487	0,04	4.100 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	3.148	0,27
110 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	93	0,01	200 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	195	0,02
100 McDonald's Corp, 1,450 %, fällig 01.09.2025	91	0,01	370 Republic Services Inc, 2,500 %, fällig 15.08.2024	355	0,03
460 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	444	0,04	140 Salesforce Inc, 3,700 %, fällig 11.04.2028	133	0,01
510 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2027	482	0,04	80 Santander Holdings USA Inc, 4,500 %, fällig 17.07.2025	78	0,01
360 McDonald's Corp, 3,500 %, fällig 01.07.2027	340	0,03	322 Schlumberger Holdings Corp, 3,900 %, fällig 17.05.2028	303	0,03
260 McDonald's Corp, 3,800 %, fällig 01.04.2028	247	0,02	430 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	479	0,04
130 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	119	0,01	150 Southwestern Electric Power Co, 6,200 %, fällig 15.03.2040	154	0,01
80 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	60	0,01	20 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 01.02.2029	19	–
720 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	599	0,05	160 Southwestern Energy Co, 5,375 %, fällig 15.03.2030	146	0,01
60 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	51	–	250 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	215	0,02
450 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	361	0,03	552 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	555	0,05
790 Merck & Co Inc, 2,750 %, fällig 10.12.2051	529	0,05	20 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	21	–
300 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	301	0,03	655 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	780	0,07
590 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	572	0,05	10 Sprint LLC, 7,875 %, fällig 15.09.2023	10	–
10 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	9	–	220 Sprint LLC, 7,625 %, fällig 15.02.2025	226	0,02
650 Microsoft Corp, 2,525 %, fällig 01.06.2050	434	0,04	420 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	413	0,04
10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	7	–	240 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	209	0,02
207 Microsoft Corp, 3,041 %, fällig 17.03.2062	145	0,01	150 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2028	143	0,01
657 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	658	0,06	290 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	275	0,02
960 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	885	0,08	490 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	446	0,04
2.060 Morgan Stanley, Series L, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	1.898	0,17	200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	170	0,01
550 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	513	0,05	16 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039	18	–
1.360 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	1.256	0,11	300 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,900 %, fällig 15.09.2044	277	0,02
50 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	47	–	30 Tenet Healthcare Corp, 4,375 %, fällig 15.01.2030	26	–
960 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	802	0,07	160 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	135	0,01
2.090 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	1.852	0,16	380 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	311	0,03
460 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	364	0,03	980 The Vanguard Group Inc, 3,050 %, fällig 22.08.2050 [†] 00%	642	0,06
680 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16.09.2036 *	508	0,04	85 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, fällig 15.07.2033	96	0,01
380 MPLX LP, 4,875 %, fällig 01.12.2024	375	0,03	182 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	175	0,02
230 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	215	0,02	420 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	421	0,04
1.290 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	1.240	0,11	560 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	495	0,04
410 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	350	0,03	50 TJX Cos Inc/The, 2,250 %, fällig 15.09.2026	46	–
20 MPLX LP, 5,200 %, fällig 01.03.2047	17	–	2.060 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2025	1.974	0,17
960 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	773	0,07	160 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	146	0,01
320 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	288	0,03	120 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	113	0,01
160 Newell Brands Inc, 4,450 %, fällig 01.04.2026	151	0,01	520 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	443	0,04
580 NIKE Inc, 2,750 %, fällig 27.03.2027	538	0,05	2.850 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	2.586	0,23
290 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	233	0,02	450 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	367	0,03
790 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	616	0,05	380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	316	0,03
320 NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	282	0,02	270 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	234	0,02
1.090 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	897	0,08	70 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	55	–
690 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	536	0,05	1.170 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	949	0,08
620 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	474	0,04	220 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	153	0,01
14 Occidental Petroleum Corp, 6,950 %, fällig 01.07.2024	14	–	10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	7	–
130 Occidental Petroleum Corp, 5,550 %, fällig 15.03.2026	129	0,01	150 Toll Brothers Finance Corp, 4,375 %, fällig 15.04.2023	150	0,01
410 Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	381	0,03	1.350 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	1.432	0,12
610 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	548	0,05	340 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 15.07.2025	330	0,03
260 Occidental Petroleum Corp, 3,000 %, fällig 15.02.2027	236	0,02	820 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	647	0,06
600 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	533	0,05	1.260 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	963	0,08
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	283	0,02			
730 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	735	0,06			
200 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	195	0,02			
240 Occidental Petroleum Corp, 4,625 %, fällig 15.06.2045	191	0,02			
520 Occidental Petroleum Corp, 6,600 %, fällig 15.03.2046	530	0,05			
100 Occidental Petroleum Corp, 4,400 %, fällig 15.04.2046	77	0,01			
520 Occidental Petroleum Corp, 4,100 %, fällig 15.02.2047	391	0,03			

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
470 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	343	0,03	1.900 Western Midstream Operating LP, 4,300 %, fällig 01.02.2030	1.685	0,15
440 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	415	0,04	40 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	33	–
690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	612	0,05	310 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	260	0,02
70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	65	0,01	310 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 01.02.2050	253	0,02
160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	153	0,01	350 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	386	0,03
210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	198	0,02	760 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15.06.2031	835	0,07
1.370 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	1.174	0,10	1.038 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	1.235	0,11
420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	353	0,03	250 Workday Inc, 3,500 %, fällig 01.04.2027	234	0,02
210 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.06.2023	209	0,02	420 Workday Inc, 3,700 %, fällig 01.04.2029	384	0,03
410 UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	398	0,03	770 Workday Inc, 3,800 %, fällig 01.04.2032	678	0,06
210 UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15.01.2026	190	0,02	110 Wyeth LLC, 5,950 %, fällig 01.04.2037	118	0,01
660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	624	0,05	46 XPO Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.05.2025	46	–
590 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	560	0,05		321.314	27,97
200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	164	0,01	Sambia – 0,06 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	91	0,01	680 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	639	0,06
400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	377	0,03	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 474.000 \$)		
160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	139	0,01		419.663	36,53
130 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	116	0,01	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 23,40 % (28. Februar 2022: 30,21 %)		
1.540 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	1.209	0,11	Argentinien – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
300 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	234	0,02	212 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	66	0,01
80 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	54	–	2.566 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,500 %, fällig 09.07.2030	837	0,07
1.410 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	1.302	0,11	1.062 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,500 %, fällig 09.07.2035	305	0,03
410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	335	0,03	1.850 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 3,500 %, fällig 09.07.2041	586	0,05
260 Verizon Communications Inc, 2,625 %, fällig 15.08.2026	239	0,02	757 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 5,250 %, fällig 01.09.2037	290	0,02
190 Verizon Communications Inc, 3,000 %, fällig 22.03.2027	176	0,02		2.084	0,18
580 Verizon Communications Inc, 2,100 %, fällig 22.03.2028	501	0,04	Brasilien – 1,02 % (28. Februar 2022: 0,95 %)		
1.062 Verizon Communications Inc, 4,329 %, fällig 21.09.2028	1.018	0,09	BRL 20.000 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	3.498	0,30
190 Verizon Communications Inc, 3,875 %, fällig 08.02.2029	177	0,02	BRL 17.099 Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	2.688	0,23
500 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	438	0,04	350 Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 4,625 %, fällig 13.01.2028	334	0,03
630 Verizon Communications Inc, 1,750 %, fällig 20.01.2031	487	0,04	6.000 Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 5,000 %, fällig 27.01.2045	4.605	0,40
1.110 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	908	0,08	880 Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 4,750 %, fällig 14.01.2050	633	0,06
2.587 Verizon Communications Inc, 2,355 %, fällig 15.03.2032	2.035	0,18		11.758	1,02
1.570 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	1.461	0,13	Kolumbien – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
580 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	567	0,05	890 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 3,250 %, fällig 22.04.2032	633	0,06
1.480 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	1.004	0,09	900 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 4,125 %, fällig 22.02.2042	554	0,05
180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	136	0,01	990 Internationale Anleihe der kolumbianischen Regierung, 5,625 %, fällig 26.02.2044	718	0,06
510 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	403	0,04		1.905	0,17
430 Verizon Communications Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2046	350	0,03	Indonesien – 0,93 % (28. Februar 2022: 1,44 %)		
550 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	497	0,04	610 Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 3,700 %, fällig 30.10.2049	482	0,04
50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	49	–	IDR 159.624.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR91, 6,375 %, fällig 15.04.2032	10.217	0,89
320 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	253	0,02		10.699	0,93
1.320 Verizon Communications Inc, 2,875 %, fällig 20.11.2050	832	0,07	Israel – 0,08 % (28. Februar 2022: 0,07 %)		
690 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	499	0,04	650 Internationale Anleihe der israelischen Regierung, 2,750 %, fällig 03.07.2030	575	0,05
200 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	174	0,02	390 Staat Israel, 3,375 %, fällig 15.01.2050	289	0,03
830 Visa Inc, 3,150 %, fällig 14.12.2025	793	0,07		864	0,08
890 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	805	0,07	Kenia – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
300 Walmart Inc, 1,500 %, fällig 22.09.2028	255	0,02	2.270 Internationale Anleihe der Republik Kenia, 144A, 6,300 %, fällig 23.01.2034	1.727	0,15
150 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22.09.2031	121	0,01	Mexiko – 3,56 % (28. Februar 2022: 2,02 %)		
170 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	193	0,02	MXN 6.990 Mexikanische Bonos, Series M 20, 10,000 %, fällig 05.12.2024	375	0,03
300 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	275	0,02	MXN 97.380 Mexikanische Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	5.092	0,44
370 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,054 %, fällig 15.03.2029	331	0,03	MXN 194.400 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	9.487	0,83
1.780 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, fällig 15.03.2032	1.538	0,13	MXN 232.457 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	10.900	0,95
130 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	105	0,01	MXN 256.970 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	12.319	1,07
1.580 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	1.240	0,11	3.210 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,600 %, fällig 10.02.2048	2.573	0,22
240 Wells Fargo & Co, 3,750 %, fällig 24.01.2024	236	0,02	190 Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 5,750 %, fällig 12.10.2110	168	0,02
1.500 Wells Fargo & Co, 1,654 %, fällig 02.06.2024 *	1.485	0,13		40.914	3,56
1.150 Wells Fargo & Co, 2,188 %, fällig 30.04.2026 *	1.070	0,09	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)		
870 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	804	0,07	USA – (Fortsetzung)		
3.940 Wells Fargo & Co, 4,300 %, fällig 22.07.2027	3.815	0,33	470 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	343	0,03
560 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	519	0,05	440 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	415	0,04
750 Wells Fargo & Co, 2,393 %, fällig 02.06.2028 *	664	0,06	690 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	612	0,05
370 Wells Fargo & Co, 4,150 %, fällig 24.01.2029	347	0,03	70 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2027	65	0,01
1.330 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	1.134	0,10	160 United Rentals North America Inc, 4,875 %, fällig 15.01.2028	153	0,01
620 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	584	0,05	210 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	198	0,02
330 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	279	0,02	1.370 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	1.174	0,10
580 Wells Fargo & Co, 4,900 %, fällig 17.11.2045	514	0,04	420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	353	0,03
720 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	591	0,05	210 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.06.2023	209	0,02
1.890 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	1.624	0,14	410 UnitedHealth Group Inc, 3,750 %, fällig 15.07.2025	398	0,03
6.180 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	5.699	0,50	210 UnitedHealth Group Inc, 1,250 %, fällig 15.01.2026	190	0,02
130 Wells Fargo & Co, Series U, 5,875 %, Ewige Anleihe *	129	0,01	660 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	624	0,05
460 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, fällig 01.02.2025	436	0,04	590 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	560	0,05
110 Western Midstream Operating LP, 4,500 %, fällig 01.03.2028	102	0,01	200 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	164	0,01

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Nigeria – 0,02 % (28. Februar 2022: 0,02 %)					
300	249	0,02	7.250	5.325	0,46
Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027			United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051		
Panama – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,10 %)					
670	500	0,04	7.650	5.145	0,45
Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 2,252 %, fällig 29.09.2032			United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051		
950	698	0,06	4.679	3.044	0,27
Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 4,500 %, fällig 01.04.2056			477		
			340		
			5.373		
			1.934		
			2.688		
			194.897		
			16,97		
Paraguay – 0,04 % (28. Februar 2022: 0,03 %)					
470	399	0,04	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 341.668 \$)		
Internationale Anleihe der paraguayischen Regierung, 144A, 3,849 %, fällig 08.03.2022			268.788		
Peru – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,19 %)					
730	603	0,05	Schuldscheindarlehen – 4,08 % (28. Februar 2022: 5,58 %)		
Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 2,783 %, fällig 23.01.2031			464		
580	570	0,05	1011778 BC ULC, 4,122 %, fällig 14.11.2026 *		
Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 5,625 %, fällig 18.11.2050			557		
			Air Canada, 8,369 %, fällig 27.07.2028 *		
			1.059		
			Ali Group S.R.L., 6,676 %, fällig 13.10.2028 *		
			1.056		
			0,09		
			549		
			Alterra Mountain Co, 8,070 %, fällig 30.07.2028 *		
			548		
			0,05		
			447		
			AmWINS Group, Inc., 6,820 %, fällig 17.02.2028 *		
			440		
			0,04		
			1.094		
			API Group Inc, 7,070 %, fällig 01.10.2026 *		
			1.094		
			0,10		
			1.627		
			Asplundh Tree Expert LLC, 6,320 %, fällig 04.09.2027 *		
			1.624		
			0,14		
			1.077		
			Asurion LLC, 8,978 %, fällig 19.08.2028 *		
			1.017		
			0,09		
			992		
			Asurion LLC, 7,820 %, fällig 18.12.2026 *		
			946		
			0,08		
			127		
			Asurion LLC, 8,680 %, fällig 17.08.2028 *		
			119		
			0,01		
			750		
			Brown Group Holding LLC, 7,047 %, fällig 07.06.2028 *		
			745		
			0,06		
			220		
			Caesars Entertainment, 7,817 %, fällig 25.01.2030 *		
			220		
			0,02		
			156		
			Castlelake Aviation Ltd, 7,519 %, fällig 22.10.2026 *		
			155		
			0,01		
			1.496		
			Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, fällig 30.04.2025 *		
			1.496		
			0,13		
			427		
			Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, fällig 01.02.2027 *		
			424		
			0,04		
			1.101		
			Citadel Securities, 7,176 %, fällig 27.02.2028 *		
			1.093		
			0,10		
			676		
			Clarios Global LP, 7,820 %, fällig 30.04.2026 *		
			675		
			0,06		
			1.830		
			DCert Buyer, Inc., 8,696 %, fällig 16.10.2026 *		
			1.806		
			0,16		
			1.316		
			Deerfield Dakota Holding LLC, 8,311 %, fällig 05.03.2027 *		
			1.266		
			0,11		
			622		
			Edelman Financial Center LLC/The, 8,070 %, fällig 05.04.2028 *		
			607		
			0,05		
			282		
			Energizer Holdings, Inc., 6,928 %, fällig 16.12.2027 *		
			281		
			0,02		
			380		
			Eyecare Partners LLC, 8,480 %, fällig 20.02.2027 *		
			320		
			0,03		
			134		
			FinCo I LLC, 7,070 %, fällig 27.06.2025 *		
			134		
			0,01		
			233		
			First Eagle Holdings Inc, 7,230 %, fällig 17.02.2027 *		
			229		
			0,02		
			1.312		
			Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, fällig 30.06.2028 *		
			1.306		
			0,11		
			1.845		
			Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, fällig 01.10.2027 *		
			1.782		
			0,16		
			350		
			Garda World Security Corp, 8,850 %, fällig 30.10.2026 *		
			351		
			0,03		
			1.906		
			Genesee & Wyoming Inc, 6,730 %, fällig 30.12.2026 *		
			1.904		
			0,17		
			104		
			GFL Environmental Inc, 7,661 %, fällig 31.05.2027 *		
			105		
			0,01		
			1.768		
			Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,570 %, fällig 15.11.2027 *		
			1.724		
			0,15		
			345		
			GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,230 %, fällig 16.03.2027 *		
			345		
			0,03		
			1.105		
			Harbor Freight Tools USA Inc, 7,320 %, fällig 19.10.2027 *		
			1.073		
			0,09		
			872		
			ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,000 %, fällig 01.07.2028 *		
			872		
			0,08		
			567		
			iHeartCommunications Inc, 7,570 %, fällig 01.05.2026 *		
			550		
			0,05		
			217		
			Indigo Merger Sub, Inc., 7,000 %, fällig 01.07.2028 *		
			217		
			0,02		
			847		
			Jane Street Group, LLC, 7,320 %, fällig 21.01.2027 *		
			844		
			0,07		
			1.280		
			Mozart Borrower LP, 7,820 %, fällig 30.09.2028 *		
			1.236		
			0,11		
			753		
			Nexstar Broadcasting Inc, 7,070 %, fällig 19.09.2026 *		
			752		
			0,07		
			264		
			PCI Gaming Authority, 7,070 %, fällig 31.05.2026 *		
			264		
			0,02		
			622		
			Phoenix Guarantor Inc, 7,820 %, fällig 05.03.2026 *		
			612		
			0,05		
			1.318		
			Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, fällig 23.09.2026 *		
			1.317		
			0,11		
			465		
			Project Sky Merger Sub, Inc., 8,320 %, fällig 10.08.2028 *		
			446		
			0,04		
			615		
			Quikrete Holdings, Inc., 7,570 %, fällig 11.06.2028 *		
			614		
			0,05		
			933		
			Rackspace Technology Global, Inc, 7,595 %, fällig 09.02.2028 *		
			591		
			0,05		
			385		
			RegionalCare Hospital Partners Holding, 8,575 %, fällig 16.11.2025 *		
			369		
			0,03		
			1.420		
			Setanta Aircraft Leasing DAC, 6,730 %, fällig 05.11.2028 *		
			1.411		
			0,12		
			1.406		
			SkyMiles IP Ltd, 8,558 %, fällig 16.09.2027 *		
			1.458		
			0,13		
			1.860		
			Sotera Health, 7,575 %, fällig 13.12.2026 *		
			1.793		
			0,16		
			1.284		
			Station Casinos LLC, 6,820 %, fällig 08.02.2027 *		
			1.279		
			0,11		
			683		
			Terrier Media Buyer, Inc., 8,230 %, fällig 17.12.2026 *		
			644		
			0,06		
			59		
			TransDigm Inc, 0,000 %, fällig 13.08.2028 *		
			59		
			0,01		
			49		
			Triton Water Holdings, Inc., 8,230 %, fällig 16.03.2028 *		
			46		
			-		
			1.319		
			UFC Holdings LLC, 7,570 %, fällig 29.04.2026 *		
			1.316		
			0,11		
			1.091		
			United Airlines Inc, 8,568 %, fällig 14.04.2028 *		
			1.092		
			0,09		
			1.110		
			Verscend Holding Corp., 8,570 %, fällig 27.08.2025 *		
			1.111		
			0,10		
			2.102		
			Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, fällig 04.01.2028 *		
			2.066		
			0,18		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 341.668 \$)					
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 47.816 \$)					
				46.862	4,08
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.352.815 \$)					
				1.183.129	103,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Gekaufte Optionen – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,03 %)			Futures – -0,32 % (28. Februar 2022: -0,60 %)		
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 96.00, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	484	0,04	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-3.625	-0,32
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	72	0,01	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-8.685	-0,77
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 520 \$)	556	0,05	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.186.290	103,27
Credit Default Swaps – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,33 %)			Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.240	0,19		-37.590	-3,27
Index-Swaps – 0,53 % (28. Februar 2022: 0,37 %)			Gesamtvermögen		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	6.036	0,53		1.148.700\$	100,00
Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,23 %)			– 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 realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	540	0,05	144A	Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 140.494.000 \$ und machten 12,27 % des Nettovermögens aus.	
Futures – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,40 %)			*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.474	0,22	†	Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.194.975	104,04	∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.	
Verkaufte Optionen – -0,06 % (28. Februar 2022: -0,10 %)			ε	Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).	
– 1 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 95.3750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-454	-0,04	±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.	
– U.S. 10 Year April 2023 Call 118.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	–	β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.	
– U.S. 10 Year April 2023 Put 110.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-33	-0,01	γ	Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.	
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.25, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-26	–	ABKÜRZUNGEN:		
– U.S. 5 Year April 2023 Call 110.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-2	–	Ewig	– Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.	
– U.S. 5 Year April 2023 Put 107.75, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-99	-0,01	REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit	
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -551 \$)	-615	-0,06	TBAv	– To be announced.	
Credit Default Swaps – -0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			BRL	– Brasilianischer Real	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-158	-0,01	IDR	– Indonesische Rupiah	
Index-Swaps – -0,04 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			MXN	– Mexikanischer Peso	
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-422	-0,04	RUB	– Russischer Rubel	
Zinsswaps – -0,11 % (28. Februar 2022: -0,20 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.287	-0,11			% des Gesamtvermögens
Devisenterminkontrakte – -0,23 % (28. Februar 2022: -0,49 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		89,97
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.578	-0,23	Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		3,71
			Finanzderivate		0,94
			Sonstige Vermögenswerte		5,38
			Gesamtvermögen		100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2027	7.385	\$ -116
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2027	215.163	2.240
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2032	3.640	-42
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.882 \$)				\$ 2.240
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				-158
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.882 \$)				\$ 2.082

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18. Juli 2029	142.060	\$ -628
Morgan Stanley	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,440 %	20. Juli 2029	147.960	-659
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 647 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.957 \$)				-1.287
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.310 \$)				\$ -1.287

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2047	834	\$ 236
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18. März 2032	8.200	1.041
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	86	12
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	6.547	838

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Index-Swaps – (Fortsetzung)

Gegenpartei	Referenzzeit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	13.519	719
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	44.069	2.363
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	26.701	827
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	30. Juni 2029	66.567	-92
Morgan Stanley	Pay Floating USD SOFR OIS Compound, Receive Fixed 3,500 %	30. Sep. 2024	13.390	-330
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.476 \$)				\$ 6.036
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				-422
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.476 \$)				\$ 5.614

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitstermin	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 173	Verkauf AUD 252	\$ 4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.017	Verkauf EUR 949	10
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 20	Verkauf EUR 19	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1	Verkauf GBP 1	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 8.827	Verkauf USD 6.139	-195
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 31.766	Verkauf USD 34.145	-514
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 29	Verkauf USD 35	–
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 3.200	Verkauf EUR 2.959	61
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf EUR 5.993	Verkauf USD 6.428	-70
18. Apr. 2023	Citi	Kauf USD 757	Verkauf MXN 14.000	-1
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf ZAR 29.450	Verkauf USD 1.719	-123
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY 756.179	Verkauf USD 5.782	-189
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 8.486	Verkauf CAD 11.405	123
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 22.716	Verkauf CNH 155.638	247
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.514	Verkauf IDR 39.288.122	-59
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf INR 156.175	Verkauf USD 1.875	8
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CAD 42.000	Verkauf USD 31.448	-652
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CNH 32.803	Verkauf USD 4.881	-145
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 2.929	Verkauf AUD 4.256	60
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf NOK 66.018	Verkauf EUR 6.215	-220
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 1.899	Verkauf GBP 1.555	27
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 199	Verkauf MXN 3.855	-10
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf AUD 17.287	Verkauf USD 12.053	-400
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.409 \$)				\$ 540
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -7.304 \$)				-2.578
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -3.895 \$)				\$ -2.038

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Morgan Stanley	-549	\$ -130.044	\$ 1.089
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Morgan Stanley	-566	-136.095	387
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Morgan Stanley	120	28.980	64
3 Month SOFR Index Juni 2023	Morgan Stanley	5	1.183	-24
3 Month SOFR Index September 2023	Morgan Stanley	73	17.263	-121
90 Day Euro\$ März 2023	Morgan Stanley	129	30.614	-46
Australia 10 Year Bond März 2023	Morgan Stanley	148	11.718	-473
Euro FX Currency März 2023	Morgan Stanley	3	397	-5
Euro-Bobl März 2023	Morgan Stanley	50	6.091	-228
Euro-Bund März 2023	Morgan Stanley	48	6.748	-216
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Morgan Stanley	-25	-3.551	748
Euro-OAT März 2023	Morgan Stanley	91	12.291	-825
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Morgan Stanley	-17	-18.310	186
Long Gilt Juni 2023	Morgan Stanley	60	7.214	-96
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	346	38.633	-23
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Morgan Stanley	-572	-67.031	-84
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	18	3.667	-8
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	1.858	198.908	-454
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	507	63.486	-235
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	575	77.661	-787
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.952 \$)				\$ 2.474
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -8.964 \$)				-3.625
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -3.012 \$)				\$ -1.151

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 43,18 % (28. Februar 2022: 38,96 %)			Norwegen – 0,76 % (28. Februar 2022: 0,92 %)		
Australien – 0,70 % (28. Februar 2022: 0,67 %)			Singapur – 0,24 % (28. Februar 2022: 0,33 %)		
	970	0,70	1.030	1.006	0,76
	Glencore Finance Europe Ltd, 1,750 %, fällig 17.03.2025		DNB Bank ASA, 0,050 %, fällig 14.11.2023		
Belgien – 0,16 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			Südafrika – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
	140	0,10	500	312	0,24
	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 2,125 %, fällig 02.12.2027		Temasek Financial I Ltd, 1,250 %, fällig 20.11.2049		
USD	90	0,06	Spanien – 1,43 % (28. Februar 2022: 0,50 %)		
	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040		1.400		
USD	8	–	Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025		
	Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048		600		
	212	0,16	Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027		
			1.895		
Brasilien – 0,52 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Supranational – 3,10 % (28. Februar 2022: 2,89 %)		
USD	930	0,52	1.240		
	Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032		African Development Bank, 0,500 %, fällig 21.03.2029		
Kanada – 1,89 % (28. Februar 2022: 0,04 %)			3.480		
USD	60	0,03	European Stability Mechanism, Series EUR, 0,750 %, fällig 05.09.2028		
	1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029		4.101		
	1.240	0,89	Schweden – 0,84 % (28. Februar 2022: 0,62 %)		
	Bank of Montreal, 2,750 %, fällig 15.06.2027		200		
USD	10	0,01	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, Ewige Anleihe *		
	MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029		185		
GBP	540	0,44	760		
	Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig 14.06.2027		Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *		
GBP	610	0,52	160		
	Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028		Verisure Holding AB, 7,288 %, fällig 15.04.2025 *		
	2.501	1,89	1.106		
			Schweiz – 1,32 % (28. Februar 2022: 1,55 %)		
China – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,01 %)			700		
USD	10	0,01	Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *		
	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 2,700 %, fällig 01.05.2025		220		
			Credit Suisse Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *		
Dänemark – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,26 %)			160		
	390	0,29	Holcim Finance Luxembourg SA, 3,000 %, Ewige Anleihe *		
	Danske Bank A/S, 0,750 %, fällig 02.06.2023		320		
			UBS AG/London, 0,500 %, fällig 31.03.2031		
Frankreich – 3,70 % (28. Februar 2022: 1,82 %)			550		
	310	0,18	UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024		
	1.400	0,90	Vereinigte Arabische Emirate – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,46 %)		
	700	0,49	200		
	200	0,17	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036		
GBP	400	0,30	180		
	600	0,40	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034		
	200	0,14	284		
	660	0,50	Vereinigtes Königreich – 5,38 % (28. Februar 2022: 5,32 %)		
	200	0,12	1.070		
	200	0,12	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12.07.2024		
	700	0,50	100		
	Thales SA, 0,750 %, fällig 23.01.2025		Aviva Plc, 3,375 %, fällig 04.12.2045 *		
	4.902	3,70	1.050		
			Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *		
Deutschland: 2,06 % (28. Februar 2022: 3,55 %)			1.300		
	800	0,43	HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027 *		
	100	0,08	1.110		
	200	0,14	Lloyds Banking Group Plc, 2,843 %, fällig 21.06.2024 *		
	400	0,27	1.190		
	600	0,40	NatWest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023		
	200	0,14	140		
	660	0,50	Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025		
	200	0,14	420		
	660	0,50	Rentokil Initial Plc, 0,950 %, fällig 22.11.2024		
	200	0,14	100		
	200	0,14	Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030		
	660	0,50	580		
	RTE Reseau de Transport d'Electricite SADIR, 2,125 %, fällig 27.09.2038		Standard Chartered Plc, 3,125 %, fällig 19.11.2024		
	158	0,12	140		
	660	0,50	Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029		
			100		
	4.902	3,70	Wellcome Trust Ltd/The, 1,125 %, fällig 21.01.2027		
			7.131		
Israel – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,23 %)			USA – 14,56 % (28. Februar 2022: 12,44 %)		
USD	10	0,01	50		
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023		3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050		
USD	440	0,27	430		
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026		AbbVie Inc, 1,250 %, fällig 01.06.2024		
	373	0,28	10		
			AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048		
Italien – 1,91 % (28. Februar 2022: 1,78 %)			420		
	1.100	0,78	Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp/Atlas Luxco 4 Sarl, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028		
	950	0,69	40		
	620	0,44	Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057		
	2.530	1,91	20		
			American International Group Inc, 2,500 %, fällig 30.06.2025		
Japan – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,43 %)			18		
	300	0,21	30		
	Asahi Group Holdings Ltd, 1,151 %, fällig 19.09.2025		American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032		
Luxemburg – 1,71 % (28. Februar 2022: 1,49 %)			220		
	555	0,31	AT&T Inc, 3,550 %, fällig 17.12.2032		
	1.400	0,88	100		
	Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, fällig 12.03.2029		AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053		
	260	0,17	40		
	Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027		Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031		
	220	0,17	1.390		
	Prologis International Funding II SA, 2,375 %, fällig 14.11.2030		Bank of America Corp, 1,379 %, fällig 07.02.2025 *		
	457	0,35	420		
	2.262	1,71	Berkshire Hathaway Inc, 1,125 %, fällig 16.03.2027		
Macau – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,20 %)			290		
USD	400	0,23	Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030		
	Sands China Ltd, 3,350 %, fällig 08.03.2029		410		
Niederlande – 1,45 % (28. Februar 2022: 1,92 %)			60		
	100	0,07	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030		
	250	0,18	13		
	320	0,19	Bristol-Myers Squibb Co, 2,900 %, fällig 26.07.2024		
	940	0,66	70		
	Euronext NV, 1,000 %, fällig 18.04.2025		Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035		
	300	0,23	70		
	ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11.04.2028 *		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032		
USD	40	0,03	52		
	Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030		13		
USD	170	0,09	200		
	Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050		CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033		
	1.925	1,45	180		
			CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034		
			20		
			Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025		
			19		
			100		
			Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053		
			74		
			180		
			Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,500 %, fällig 01.04.2063		
			132		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,54 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
USD 692 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	654	0,50		124.983	94,36
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 648 €)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	654	0,50		7.484	5,64
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 145.761 €)			Gesamt Nettovermögen		
	125.838	95,00		132.467 €	100,00
Kontrakte (in Tsd.)			ABKÜRZUNGEN:		
Gekaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Ewig – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
USD – U.S. 10 Year April 2023 Call 114.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	4	–	GBP – Britisches Pfund Sterling		
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 5 €)			PLN – Polnischer Zloty		
	4	–	USD – US-Dollar		
Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,04 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	72	0,05	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
Futures – 0,36 % (28. Februar 2022: 0,38 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	476	0,36	Finanzderivate		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			Sonstige Vermögenswerte		
	126.390	95,41	Gesamtvermögen		
Kontrakte (in Tsd.)			% des Gesamtvermögens		
Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			93,32		
USD – U.S. 10 Year April 2023 Put 109.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-4	–	0,49		
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -4 €)			0,41		
	-4	–	5,78		
Devisenterminkontrakte – -0,25 % (28. Februar 2022: -0,38 %)			Gesamtvermögen		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-338	-0,25	100,00		
Futures – -0,80 % (28. Februar 2022: -0,40 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.065	-0,80			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
	-1.407	-1,05			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
16. Mai 2023	Citi	Kauf SEK 15.480	Verkauf EUR 1.360	€ 37
16. Mai 2023	Citi	Kauf EUR 49	Verkauf JPY 6.900	1
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf EUR 69	Verkauf CAD 100	–
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 525	Verkauf EUR 486	9
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf EUR 439	Verkauf GBP 394	-8
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf EUR 3.662	Verkauf USD 3.964	-69
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 225	Verkauf AUD 352	2
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 359	Verkauf CAD 522	-1
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf GBP 403	Verkauf EUR 453	4
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf NOK 18.585	Verkauf EUR 1.681	10
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 165	Verkauf EUR 152	3
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 2.775	Verkauf GBP 2.493	-51
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 328	Verkauf JPY 46.350	4
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 1.627	Verkauf PLN 7.780	-11
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 7.819	Verkauf USD 8.466	-149
16. Mai 2023	UBS	Kauf USD 181	Verkauf EUR 168	2
16. Mai 2023	UBS	Kauf EUR 2.698	Verkauf USD 2.919	-49
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 59 €)				€ 72
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -569 €)				-338
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -510 €)				€ -266

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	42	€ 9.548	€ -3
Euribor 3 Month Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	80	19.323	-151
Euro-Bobl März 2023	Bank of America Merrill Lynch	92	10.597	-444
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	117	15.550	-424
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-13	-1.746	338
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-11	-11.202	120
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	21	2.387	-12
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-8	-844	1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte – (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-56	-6.205	-8
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	8	1.541	-4
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	49	4.960	-19
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-15	-1.915	17
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 567 €)				€ 476
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -590 €)				-1.065
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -23 €)				€ -589

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 0,24 % (28. Februar 2022: 0,80 %)			Gibraltar – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M5, 5,562 %, fällig 25.12.2035 *	549	0,24	EUR 750 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	682	0,30
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 576 \$)	549	0,24	Guatemala – 1,05 % (28. Februar 2022: 0,47 %)		
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 1,81 % (28. Februar 2022: 3,08 %)			1.400 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029 *	1.290	0,57
580 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,657 %, fällig 15.11.2061 *	533	0,23	1.233 Millicom International Cellular SA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	1.087	0,48
730 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class B1, 144A, 7,984 %, fällig 25.10.2033 *	710	0,31		2.377	1,05
947 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05.11.2038 *	857	0,38	Indien – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
5.300 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 13,096 %, fällig 15.06.2035 **	–	–	420 ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, fällig 18.03.2026	400	0,18
14 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2007-LDP12, Series 2007 LD12, Class AJ, 6,673 %, fällig 15.02.2051 *	12	–	Indonesien – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
387 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 7,417 %, fällig 27.02.2024 *	381	0,17	460 Pertamina Persero PT, 3,100 %, fällig 27.08.2030	396	0,17
666 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-1, Series 2017 1, Class M1, 144A, 4,000 %, fällig 25.01.2056 *	657	0,29	Irland – 0,69 % (28. Februar 2022: 0,91 %)		
1.518 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 5,577 %, fällig 25.12.2045 *	970	0,43	590 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	473	0,21
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 9.954 \$)	4.120	1,81	1.100 Park Aerospace Holdings Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.02.2024	1.087	0,48
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 55,37 % (28. Februar 2022: 54,33 %)				1.560	0,69
Argentinien – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,38 %)			Israel – 0,99 % (28. Februar 2022: 0,76 %)		
500 YPF SA, 8,500 %, fällig 28.07.2025	449	0,20	1.170 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	1.158	0,51
Belgien – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,57 %)			1.250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	1.093	0,48
180 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	165	0,07		2.251	0,99
110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	97	0,04	Italien – 1,51 % (28. Februar 2022: 0,66 %)		
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	35	0,02	EUR 620 Castor SpA, 6,000 %, fällig 15.02.2029	607	0,27
EUR 195 Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig 30.07.2026	116	0,05	EUR 500 International Design Group SPA, 6,904 %, fällig 15.05.2026 *	523	0,23
	413	0,18	EUR 1.210 Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, Ewige Anleihe *	1.143	0,50
Brasilien – 1,95 % (28. Februar 2022: 3,34 %)			EUR 270 Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	248	0,11
1.400 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	1.162	0,51	EUR 1.010 Telecom Italia SpA/Milano, 2,375 %, fällig 12.10.2027	906	0,40
1.310 Braskem America Finance Co, 7,125 %, fällig 22.07.2041	1.236	0,54		3.427	1,51
1.040 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	958	0,42	Kasachstan – 1,01 % (28. Februar 2022 0,86 %)		
1.060 Vale Overseas Ltd, 6,250 %, fällig 10.08.2026	1.082	0,48	460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	416	0,18
	4438	1,95	660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	495	0,22
Kanada – 0,99 % (28. Februar 2022: 1,42 %)			1.520 KazTransGas JSC, 4,375 %, fällig 26.09.2027	1.374	0,61
1.200 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.01.2028	1.069	0,47		2.285	1,01
380 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029	355	0,15	Luxemburg – 0,47 % (28. Februar 2022: 0,42 %)		
260 Open Text Corp, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2028	224	0,10	GBP 1.040 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	1.077	0,47
740 Open Text Holdings Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2030	610	0,27	Macau – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
	2.258	0,99	530 Sands China Ltd, 3,350 %, fällig 08.03.2029	434	0,19
Chile – 0,14 % (28. Februar 2022: 0,12 %)			Mexiko – 1,97 % (28. Februar 2022: 1,56 %)		
410 Antofagasta Plc, 2,375 %, fällig 14.10.2030	325	0,14	1.250 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Ewige Anleihe *	1.173	0,52
China – 0,53 % (28. Februar 2022: 0,25 %)			1.360 BBVA Bancomer SA/Texas, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	1.225	0,54
1.980 Prosus NV, 3,832 %, fällig 08.02.2051	1.202	0,53	1.220 Orbia Advance Corp SAB de CV, 5,875 %, fällig 17.09.2044	1.075	0,47
Kolumbien – 0,24 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			1.070 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	1.001	0,44
550 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	540	0,24		4.474	1,97
Finnland – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Niederlande – 1,90 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
EUR 650 Nordea Bank Abp, 3,500 %, Ewige Anleihe *	646	0,28	250 Cooperatieve Rabobank UA, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	233	0,10
Frankreich – 2,03 % (28. Februar 2022: 1,07 %)			EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	185	0,08
EUR 1.000 BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig 31.03.2032 *	941	0,42	EUR 800 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Ewige Anleihe *	720	0,32
1.690 BNP Paribas SA, 7,375 %, Ewige Anleihe *	1.682	0,74	GBP 1,100 ING Groep NV, 5,000 %, fällig 30.08.2026 *	1.306	0,57
EUR 560 Burger King France SAS, 7,232 %, fällig 01.11.2026 *	592	0,26	1.510 Trivium Packaging Finance BV, 5,500 %, fällig 15.08.2026	1.428	0,63
EUR 570 Goldstory SASU, 5,375 %, fällig 01.03.2026	567	0,25	550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	453	0,20
EUR 570 IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 01.12.2025	590	0,26		4.325	1,90
EUR 220 Kapla Holding SAS, 7,982 %, fällig 15.07.2027 *	235	0,10	Peru – 0,63 % (28. Februar 2022: 1,74 %)		
	4.607	2,03	610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	406	0,18
Deutschland – 2,93 % (28. Februar 2022: 1,60 %)			1.110 Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig 30.04.2028	1.036	0,45
2.600 Allianz SE, 3,200 %, Ewige Anleihe *	1.962	0,86		1.442	0,63
EUR 680 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	621	0,27	Slowenien – 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 400 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	376	0,17	EUR 1.020 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	831	0,37
GBP 900 Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026 *	1.031	0,45	Südafrika – 0,09 % (28. Februar 2022: 0,54 %)		
EUR 800 Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig 15.07.2025	838	0,37	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	0,09
EUR 558 TK Elevator Holdco GmbH, 6,625 %, fällig 15.07.2028	507	0,22	Spanien – 0,49 % (28. Februar 2022: 1,05 %)		
EUR 540 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	512	0,23	EUR 600 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	573	0,25
EUR 900 ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	822	0,36	EUR 300 Telefonica Europe BV, 2,376 %, Ewige Anleihe *	246	0,11
	6.669	2,93	EUR 300 Telefonica Europe BV, 3,875 %, Ewige Anleihe *	294	0,13
				1.113	0,49
			Schweden – 0,77 % (28. Februar 2022: 0,36 %)		
			EUR 680 Heimstaden Bostad AB, 3,625 %, Ewige Anleihe *	459	0,20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Ägypten – 0,85 % (28. Februar 2022: 0,74 %)					
1.360	1.095	0,48	820	687	0,30
EUR 1.180	837	0,37	430	352	0,15
	1.932	0,85	40	22	0,01
			200	115	0,05
			270	227	0,10
				25.223	11,09
Gabun – 0,56 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
1.550	1.266	0,56	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 80.445 \$)		
				59.183	26,03
Deutschland – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
EUR 360	331	0,15	Schuldscheindarlehen – 3,84 % (28. Februar 2022: 4,09 %)		
			582	582	0,26
Indonesien – 2,96 % (28. Februar 2022: 2,96 %)					
IDR45.226.000	3.016	1,33	873	874	0,38
IDR52.396.000	3.711	1,63	675	638	0,28
	6.727	2,96	811	810	0,36
			629	626	0,27
Jordanien – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
430	389	0,17	463	452	0,20
			1.166	1.166	0,51
Mexiko – 3,33 % (28. Februar 2022: 2,84 %)					
MXN 161.267	7.562	3,33	138	137	0,06
			270	270	0,12
Nigeria – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
1.400	942	0,42	587	587	0,26
			929	928	0,41
Oman – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
390	392	0,17	600	578	0,25
			893	841	0,37
Panama – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,22 %)					
680	499	0,22	246	245	0,11
Polen – 1,46 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PLN 21.700	3.319	1,46	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 8.881 \$)		
				8.734	3,84
Rumänien – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,27 %)					
EUR 940	666	0,29	Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,77 % (28. Februar 2022: 9,56 %)		
			EUR 10	1.117	0,49
Russland – 0,18 % (28. Februar 2022: 1,14 %)					
RUB 288.495	192	0,08	22	2.899	1,28
RUB 329.535	220	0,10	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.638 \$)		
	412	0,18		4.016	1,77
Südafrika – 1,46 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
ZAR 72.778	2.497	1,10	Stammaktien – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
1.130	827	0,36	USA – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,15 %)		
	3.324	1,46	44	414	0,18
USA – 11,09 % (28. Februar 2022: 3,45 %)					
6.240	6.021	2,65	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 491 \$)		
30	24	0,01	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 245.972 \$)		
5.680	4.625	2,03		202.891	89,24
3.320	3.373	1,48	Devisenterminkontrakte – 0,34 % (28. Februar 2022: 1,52 %)		
120	83	0,04	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
140	101	0,04	Futures – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
600	540	0,24	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
830	818	0,36	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
1.650	1.378	0,61	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
15	12	0,01	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
500	361	0,16	Gesamtnettovermögen		
360	300	0,13	227.355 \$ 100,00		
7.240	6.184	2,72			
			– 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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 33.298.000 \$ und machten 14,65 % des Nettovermögens aus.		
			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.		
			ε Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).		
			† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.		
			γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

Ewig	– Eine 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
MXN	– Mexikanischer Peso
PLN	– Polnischer Zloty
RUB	– Russischer Rubel
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	81,72
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	3,75
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,73
Finanzderivate	0,36
Sonstige Vermögenswerte	12,44
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
9. März 2023	Citi	Kauf USD 2.714	Verkauf IDR 42.183.819	\$ -51
9. März 2023	Citi	Kauf USD 3.589	Verkauf INR 293.376	43
9. März 2023	Citi	Kauf IDR 42.183.820	Verkauf USD 2.740	26
9. März 2023	Citi	Kauf INR 66.504	Verkauf USD 800	4
9. März 2023	Citi	Kauf INR 92.144	Verkauf USD 1.133	-19
9. März 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 3.306	Verkauf TWD 99.169	48
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.783	Verkauf AUD 2.586	42
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.390	Verkauf CHF 1.282	26
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 185	Verkauf EUR 171	2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 102	Verkauf GBP 84	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 59	Verkauf PLN 265	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 24	Verkauf SGD 33	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1	Verkauf SGD 1	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 1.571	Verkauf USD 1.899	-8
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 1.324	Verkauf USD 999	-17
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 91.256	Verkauf USD 63.460	2.019
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 52.599	Verkauf USD 57.329	1.385
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 7.160	Verkauf USD 7.696	-117
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf PLN 12.075	Verkauf USD 2.726	-14
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf ZAR 6.522	Verkauf USD 366	-12
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 8	Verkauf ZAR 147	–
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD 3.205	Verkauf PLN 14.200	30
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf JPY 666.617	Verkauf USD 5.141	-190
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD 7.731	Verkauf GBP 6.381	44
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 4.380	Verkauf EUR 4.061	65
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 2.250	Verkauf GBP 1.857	14
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 1.848	Verkauf MXN 35.905	-85
16. Mai 2023	HSBC	Kauf USD 573	Verkauf EUR 540	-1
16. Mai 2023	HSBC	Kauf USD 25.616	Verkauf EUR 23.751	380
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.024	Verkauf GBP 1.671	11
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf ZAR 5.000	Verkauf USD 282	-11
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf AUD 3.230	Verkauf USD 2.245	-65
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf CAD 1.230	Verkauf USD 917	-14
16. Mai 2023	UBS	Kauf USD 7.454	Verkauf GBP 6.157	37
16. Mai 2023	UBS	Kauf GBP 644	Verkauf USD 773	3
13. Juni 2023	Citi	Kauf USD 1.407	Verkauf IDR 21.548.873	-3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.595 \$)				\$ 775
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.265 \$)				-4.011
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.330 \$)				\$ -3.236

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-5	\$ -609	\$ 24
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-1	-142	28
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-39	-4.355	8
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	2.445	-6
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-133	-14.238	-23
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-23	-2.880	14
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 104 \$)				\$ 74
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.281 \$)				-29
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.177 \$)				\$ 45

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 6,50 % (28. Februar 2022: 4,73 %)			1.000 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029		
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 7,908 %, fällig 20.10.2031 *	477	0,38	886	1.582	0,71
250 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 8,142 %, fällig 15.04.2034 *	240	0,19	Italien – 0,70 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
310 AGL CLO 6 Ltd, Series 2020 6A, Class ER, 144A, 11,308 %, fällig 20.07.2034 *	287	0,23	380 Telecom Italia Capital SA, 6,000 %, fällig 30.09.2034	318	0,25
400 Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144A, 10,602 %, fällig 17.04.2029 *	385	0,31	660 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	561	0,45
300 Apex Credit CLO 2022-1 Ltd, Series 2022 1A, Class D, 144A, 9,053 %, fällig 22.04.2033 *	286	0,23	879 0,70		
440 Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 7,958 %, fällig 20.04.2031 *	419	0,33	Luxemburg – 1,51 % (28. Februar 2022: 0,81 %)		
420 Canyon CLO 2020-1 Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,142 %, fällig 15.07.2034 *	375	0,30	500 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	409	0,32
250 CFC Funding 2017-I Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 8,315 %, fällig 23.04.2029 *	245	0,20	710 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	587	0,47
300 GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd, Series 2014 9A, Class DR2, 144A, 7,802 %, fällig 29.10.2029 *	290	0,23	1.100 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	901	0,72
250 Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 9,742 %, fällig 15.04.2031 *	210	0,17	1.897 1,51		
510 Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class E, 144A, 10,508 %, fällig 20.01.2030 *	450	0,36	Macau – 1,80 % (28. Februar 2022: 0,97 %)		
250 Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,208 %, fällig 20.04.2034 *	221	0,18	200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig 08.01.2026	185	0,15
443 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,472 %, fällig 15.10.2031 *	404	0,32	200 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig 08.08.2028	189	0,15
500 Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 8,338 %, fällig 20.01.2032 *	434	0,35	450 Sands China Ltd, 3,750 %, fällig 08.08.2031	356	0,28
280 Mountain View CLO IX Ltd, Series 2015 9A, Class CR, 144A, 7,912 %, fällig 15.07.2031 *	241	0,19	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2026	183	0,15
500 Nassau 2021-I Ltd, Series 2021 1A, Class D, 144A, 8,542 %, fällig 26.08.2034 *	433	0,35	1.120 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	960	0,77
250 Neuberger Berman CLO XVIII Ltd, Series 2014 18A, Class DR2, 144A, 10,735 %, fällig 21.10.2030 *	221	0,18	460 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	378	0,30
500 Neuberger Berman Loan Advisers CLO 34 Ltd, Series 2019 34A, Class ER, 144A, 11,139 %, fällig 20.01.2035 *	464	0,37	2.251 1,80		
300 Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 8,265 %, fällig 13.10.2031 *	256	0,20	Niederlande – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,16 %)		
200 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D, 144A, 0,000 %, fällig 20.01.2035 *	199	0,16	420 UPC Holding BV, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	372	0,30
580 Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144A, 8,003 %, fällig 22.06.2030 *	518	0,41	Polen – 0,36 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
280 Trinitas CLO X Ltd, Series 2019 10A, Class DR, 144A, 8,232 %, fällig 15.01.2035 *	254	0,20	570 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.11.2029	454	0,36
320 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class DRR, 144A, 7,612 %, fällig 15.04.2027 *	299	0,24	Puerto Rico – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
100 Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144A, 10,532 %, fällig 15.04.2027 *	85	0,07	40 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, fällig 15.07.2024	37	0,03
500 Vibrant CLO XI Ltd, Series 2019 11A, Class CR, 144A, 8,308 %, fällig 20.07.2032 *	444	0,35	Schweiz – 2,04 % (28. Februar 2022: 0,77 %)		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 8.803 \$)	8.137	6,50	200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Ewige Anleihe *†‡	148	0,12
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 84,70 % (28. Februar 2022: 86,26 %)			1.520 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Ewige Anleihe *†‡	1.379	1,10
Bermudas – 0,65 % (28. Februar 2022: 0,31 %)			920 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,375 %, Ewige Anleihe *†‡	682	0,55
881 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025	811	0,65	390 Vistalet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2030	342	0,27
Kanada – 2,47 % (28. Februar 2022: 1,82 %)			2.551 2,04		
230 ATS Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.12.2028	201	0,16	Vereinigtes Königreich – 2,54 % (28. Februar 2022: 1,44 %)		
620 Bombardier Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2027	617	0,49	1.280 Barclays Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	1.270	1,01
420 Bombardier Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.02.2029	412	0,33	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	647	0,52
200 Cascades Inc/Cascades USA Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.01.2028	181	0,15	250 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	227	0,18
440 Empire Communities Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.12.2025	393	0,31	770 Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2028	669	0,53
800 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	707	0,57	450 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	373	0,30
50 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	51	0,04	3.186 2,54		
520 Open Text Corp, 144A, 6,900 %, fällig 01.12.2027	526	0,42	USA – 67,88 % (28. Februar 2022: 74,05 %)		
	3.088	2,47	340 Academy Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2027	322	0,26
Cayman Islands – 0,91 % (28. Februar 2022: 1,03 %)			742 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028	784	0,63
1.259 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.139	0,91	240 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028	192	0,15
Frankreich – 0,28 % (28. Februar 2022: 1,24 %)			550 AdaptHealth LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.08.2029	462	0,37
450 Altice France SA/France, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029	349	0,28	120 AdaptHealth LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01.03.2030	104	0,08
Hongkong – 0,45 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			217 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	200	0,16
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 06.06.2025	187	0,15	290 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030	277	0,22
450 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	374	0,30	500 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2025	398	0,32
	561	0,45	1.830 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	791	0,63
Indien – 0,25 % (28. Februar 2022: 0,29 %)			370 Alta Equipment Group Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2026	346	0,28
340 CA Magnum Holdings, 144A, 5,375 %, fällig 31.10.2026	314	0,25	290 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.06.2026	150	0,12
Israel – 1,26 % (28. Februar 2022: 0,96 %)			620 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2029	372	0,30
770 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	696	0,55	480 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025	527	0,42
			310 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	303	0,24
			340 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	324	0,26
			230 American Axle & Manufacturing Inc, 6,500 %, fällig 01.04.2027	213	0,17
			580 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	469	0,37
			467 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026	534	0,43
			90 Anagram International Inc / Anagram Holdings LLC, 144A, 10,000 %, fällig 15.08.2026	72	0,06
			930 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029	718	0,57
			200 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 4,000 %, fällig 01.09.2029	160	0,13

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
510 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	404	0,32	490 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.01.2029	424	0,34
180 Bath & Body Works Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01.07.2025	191	0,15	510 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.09.2028	444	0,35
900 Bath & Body Works Inc, 7,500 %, fällig 15.06.2029	904	0,72	250 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	221	0,18
180 Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.10.2030	171	0,14	770 Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig 15.11.2025	696	0,56
480 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2027	332	0,26	890 Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2029	733	0,59
690 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	304	0,24	440 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	334	0,27
400 Bausch Health Cos Inc, 144A, 5,250 %, fällig 30.01.2030	173	0,14	930 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	867	0,69
800 Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	755	0,60	900 Ford Motor Credit Co LLC, 5,113 %, fällig 03.05.2029	823	0,66
150 Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig 15.03.2027	134	0,11	340 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 06.03.2030	345	0,28
700 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026	683	0,55	1.230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	1.027	0,82
370 Boyne USA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.05.2029	328	0,26	270 Foundation Building Materials Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.03.2029	214	0,17
430 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	400	0,32	670 Freeport-McMoran Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	606	0,48
600 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2028	524	0,42	800 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	769	0,61
620 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	536	0,43	410 Gannett Holdings LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2026	345	0,28
280 Caesars Entertainment Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.07.2027	283	0,23	370 Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	361	0,29
640 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	646	0,52	400 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,875 %, fällig 15.04.2030	402	0,32
400 Cano Health LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2028	262	0,21	1.080 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	930	0,74
100 Carnival Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.03.2026	90	0,07	360 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	335	0,27
570 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	552	0,44	207 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	225	0,18
220 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	236	0,19	510 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2032	463	0,37
800 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	599	0,48	500 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2027	477	0,38
820 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	660	0,53	150 iHeartCommunications Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	131	0,10
370 Carrolls Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	282	0,23	230 iHeartCommunications Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.01.2028	194	0,15
740 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	600	0,48	1.200 IIP Operating Partnership LP, 5,500 %, fällig 25.05.2026	1.040	0,83
1.180 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	935	0,75	200 Installed Building Products Inc, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2028	186	0,15
200 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	156	0,12	300 Iron Mountain Information Management Services Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2032	248	0,20
370 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	277	0,22	310 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2029	272	0,22
470 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	460	0,37	180 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2027	153	0,12
970 Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	936	0,75	390 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	318	0,25
200 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	140	0,11	200 Legacy LifePoint Health LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2025	191	0,15
140 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	96	0,08	740 Legends Hospitality Holding Co LLC / Legends Hospitality Co-Issuer Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.02.2026	674	0,54
860 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	689	0,55	510 LSF11 A5 HoldCo LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	433	0,35
470 Clarivate Science Holdings Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2029	406	0,32	130 Madison IAQ LLC, 144A, 4,125 %, fällig 30.06.2028	111	0,09
240 Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2031	239	0,19	570 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig 30.06.2029	455	0,36
410 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2029	332	0,27	270 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.06.2028	240	0,19
480 CNX Midstream Partners LP, 144A, 4,750 %, fällig 15.04.2030	394	0,31	680 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	533	0,43
360 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	217	0,17	600 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	493	0,39
110 CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	94	0,07	440 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	367	0,29
970 CommScope Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	792	0,63	740 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	558	0,45
380 Compass Group Diversified Holdings LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.04.2029	332	0,26	280 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2028	242	0,19
420 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.02.2028	410	0,33	420 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, fällig 15.01.2030	331	0,26
810 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	687	0,55	621 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	622	0,50
320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	184	0,15	570 MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2030	463	0,37
250 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	181	0,14	430 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, fällig 15.12.2027	459	0,37
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	213	0,17	340 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	233	0,19
430 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	229	0,18	980 Nabors Industries Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2026	934	0,75
620 Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	600	0,48	880 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	817	0,65
260 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	268	0,21	200 NCL Corp Ltd, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	203	0,16
700 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	627	0,50	20 NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	17	0,01
1.130 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	878	0,70	140 NextEra Energy Partners LP, 144A, 2,500 %, fällig 15.06.2026	128	0,10
1.050 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	841	0,67	490 NMG Holding Co Inc / Neiman Marcus Group LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.04.2026	473	0,38
1.010 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	598	0,48	410 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	408	0,33
680 Diversified Healthcare Trust, 9,750 %, fällig 15.06.2025	660	0,53	800 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	773	0,62
500 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15.02.2028	326	0,26	760 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ^{oss}	–	–
440 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	333	0,27	540 Occidental Petroleum Corp, 8,875 %, fällig 15.07.2030	614	0,49
350 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	246	0,20	220 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	221	0,18
320 Earthstone Energy Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	307	0,25	30 Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	30	0,02
160 Edgewell Personal Care Co, 144A, 4,125 %, fällig 01.04.2029	137	0,11	1.040 Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027 ^{te}	784	0,63
400 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	329	0,26			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
220			920		
Park Intermediate Holdings LLC / PK Domestic Property LLC / PK Finance Co-Issuer, 144A, 5,875 %, fällig 01.10.2028			Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044		
196	0,16		778	0,62	
600	458	0,37	800	409	0,33
Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027			WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029		
478	0,38		440	439	0,35
600	478		Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031		
Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2029			631	0,50	
200	180	0,14	160	162	0,13
Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029			XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034		
250	244	0,19	440	370	0,30
PetSmart Inc / PetSmart Finance Corp, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029			ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030		
230	193	0,15	430	358	0,29
PGT Innovations Inc, 144A, 4,375 %, fällig 01.10.2029			ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.02.2029		
370	338	0,27	85.019	67,88	
PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028			Sambia – 1,27 % (28. Februar 2022: 1,08 %)		
660	613	0,49	290	282	0,23
Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028			First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025		
430	262	0,21	1.390	1.305	1,04
Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028			First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027		
40	24	0,02	1.587	1,27	
Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 120.932 \$)		
590	606	0,48	106.077	84,70	
Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
290	260	0,21	Argentinien – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030			55	17	0,01
400	330	0,26	Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029		
600	634	0,51	480	157	0,13
ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026			Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,500 %, fällig 09.07.2030		
280	218	0,17	94	27	0,02
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01.03.2031			Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,500 %, fällig 09.07.2035		
1.060	785	0,63	190	73	0,06
Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033			Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 5,250 %, fällig 01.09.2037		
630	545	0,44	274	0,22	
Roller Bearing Co of America Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.10.2029			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 389 \$)		
380	350	0,28	274	0,22	
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31.08.2026			Schuldscheindarlehen – 5,28 % (28. Februar 2022: 5,58 %)		
310	330	0,26	179	171	0,14
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig 15.08.2027			19th Holdings Golf, LLC, 7,667 %, fällig 07.02.2029 *		
590	592	0,47	322	322	0,26
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2030			Adtalem Global Education Inc, 8,547 %, fällig 12.02.2028 *		
370	317	0,25	429	403	0,32
Ryan Specialty Group LLC, 144A, 4,375 %, fällig 01.02.2030			Asurion LLC, 8,680 %, fällig 17.08.2028 *		
530	530	0,42	570	533	0,43
Sabre GLB Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2027			DCert Buyer, Inc., 11,696 %, fällig 16.02.2029 *		
2	–		190	178	0,14
Service Corp International/US, 7,500 %, fällig 01.04.2027			Deerfield Dakota Holding LLC, 11,320 %, fällig 14.04.2028 *		
460	415	0,33	341	292	0,23
Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027			Equinox Holdings Inc, 13,730 %, fällig 08.03.2024 *		
390	318	0,25	390	328	0,26
Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029			Eyecare Partners LLC, 8,480 %, fällig 05.02.2027 *		
360	329	0,26	496	494	0,39
Sizzling Platter LLC / Sizzling Platter Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 28.11.2025			Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, fällig 30.06.2028 *		
340	302	0,24	232	208	0,17
Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028			Global Tel'Link Corp, 9,076 %, fällig 29.11.2025 *		
1.050	903	0,72	353	348	0,28
Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032			Great Outdoors Group LLC, 8,320 %, fällig 05.03.2028 *		
360	333	0,27	395	338	0,27
Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2027			Magenta Buyer LLC, 9,580 %, fällig 03.05.2028 *		
250	205	0,16	303	303	0,24
Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026			Mister Car Wash, 7,661 %, fällig 14.05.2026 *		
170	171	0,14	160	148	0,12
Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025			Neptune Bidco U.S. Inc, 0,000 %, fällig 11.04.2029 *		
560	667	0,53	463	455	0,36
Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032			Phoenix Guarantor Inc, 7,820 %, fällig 05.03.2026 *		
740	536	0,43	296	244	0,19
StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029			Redstone Holdco 2 LP, 9,568 %, fällig 27.04.2028 *		
240	242	0,19	698	684	0,55
StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025			Rent-A-Center Inc/TX, 8,125 %, fällig 17.02.2028 *		
220	208	0,17	412	408	0,33
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP / Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.05.2025			Spencer Spirit IH LLC, 10,517 %, fällig 14.06.2026 *		
510	485	0,39	140	101	0,08
Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.10.2026			TruGreen LP, 13,325 %, fällig 30.10.2028 *		
1.120	977	0,78	393	264	0,21
Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026			U.S. Renal Care Inc, 9,625 %, fällig 26.06.2026 *		
200	173	0,14	394	394	0,31
Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030			Verscend Holding Corp., 8,570 %, fällig 27.08.2025 *		
480	455	0,36	6.616	5,28	
Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028			Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,33 % (28. Februar 2022: 0,35 %)		
390	325	0,26	1.661 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		
100	92	0,07	1.661	1,33	
TransDigm Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2027			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.661 \$)		
580	578	0,46	1.661	1,33	
TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028			Vorzugsaktien – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,93 %)		
290	249	0,20	USA – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,93 %)		
TransDigm Inc, 4,625 %, fällig 15.01.2029			18	642	0,51
520	530	0,42	Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 580 \$)		
Transocean Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2030			18 MPLX LP, Series A ∞		
520	415	0,33	642	0,51	
Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 139.463 \$)		
460	408	0,33	123.407	98,54	
United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029			Credit Default Swaps – 0,08 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
1.450	1.368	1,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030			102		
250	215	0,17	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
370	331	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Urban One Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2028			1		
410	420	0,34	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027			123.510		
320	415	0,33	Credit Default Swaps – -0,09 % (28. Februar 2022: -0,01 %)		
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.000	816	0,65	-116		
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033			Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2022: -0,02 %)		
750	807	0,64	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
610	531	0,42	-35		
Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028			Futures – -0,02 % (28. Februar 2022: -0,03 %)		
590	628	0,50	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025			-31		
120	103	0,08	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027			-182		
450	387	0,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten Gewinn oder Verlust		
Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029			123.328		
390	344	0,27	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028			1.912		
Gesamtneuvermögen				125.240 \$	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 90.476.000 \$ und machten 72,27 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- † Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.
- ∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.
- ε Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

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

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Beazer Homes USA, Inc, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2027	580	\$ 11
Goldman Sachs	Ford Motor Co, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2026	900	70
Goldman Sachs	KB Home, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2027	812	-69
Goldman Sachs	Nova Chemicals Corp, 5,000 % – Kauf	20. Juni 2027	429	-21
Goldman Sachs	Occidental Petroleum Corporation, 1,000 % – Verkauf	20. Juni 2026	920	-1
Goldman Sachs	The Goodyear Tire & Rubber Co, 5,000 % – Kauf	20. Juni 2027	580	-25
Goldman Sachs	Xerox Holdings Corp, 1,000 % – Kauf	20. Juni 2027	231	21
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 112 \$)				\$ 102
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -19 \$)				-116
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 93 \$)				\$ -14

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 49	Verkauf EUR 46	\$ 1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf GBP 1	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 12	Verkauf SGD 17	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 528	Verkauf USD 398	-7
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 35	Verkauf USD 42	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.711	Verkauf USD 1.840	-28
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 6	Verkauf CAD 8	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -41 \$)				-35
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -41 \$)				\$ -34

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Goldman Sachs	76	\$ 8.136
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 47 \$)			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -72 \$)			-31
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -25 \$)			\$ -31

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,40 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			Mexiko – 1,56 % (28. Februar 2022: 2,81 %)		
250 Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,472 %, fällig 15.10.2031 *	228	0,40	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,625 %, Ewige Anleihe *	189	0,33
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 247 \$)	228	0,40	360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, Ewige Anleihe *	310	0,54
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 73,14 % (28. Februar 2022: 66,19 %)			Niederlande – 1,12 % (28. Februar 2022: 1,16 %)		
Brasilien – 1,86 % (28. Februar 2022: 4,15 %)			Peru – 1,00 % (28. Februar 2022: 0,88 %)		
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	373	0,65	750 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032	575	1,00
900 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	695	1,21	Polen – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	1.068	1,86	300 Canpack SA / Canpack US LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.11.2029	239	0,42
Kanada – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,91 %)			Slowenien – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
340 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2029	289	0,50	200 United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	163	0,28
Cayman Islands – 1,78 % (28. Februar 2022: 1,04 %)			Schweden – 1,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
1.131 Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 15.09.2024	1.024	1,78	EUR 200 Heimstaden AB, 4,250 %, fällig 09.03.2026	161	0,28
China – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,45 %)			EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 1,125 %, fällig 04.09.2026	249	0,43
400 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, fällig 23.01.2024 €	40	0,07	EUR 300 Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB, 2,624 %, Ewige Anleihe *	142	0,25
400 China Aoyuan Group Ltd, 6,350 %, fällig 08.02.2024 €	41	0,07	EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	293	0,51
600 Yuzhou Group, 0,000 %, fällig 25.10.2023 €	80	0,14		845	1,47
	161	0,28	Schweiz – 2,38 % (28. Februar 2022: 0,37 %)		
Kolumbien – 0,44 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			250 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033 *	225	0,39
260 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	255	0,44	850 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Ewige Anleihe *t€	628	1,09
Frankreich – 0,93 % (28. Februar 2022: 0,97 %)			280 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Ewige Anleihe *t€	254	0,44
520 Altice France SA/France, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	407	0,71	300 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *t€	263	0,46
EUR 120 Burger King France SAS, 7,232 %, fällig 01.11.2026 *	127	0,22		1.370	2,38
	534	0,93	Türkei – 1,19 % (28. Februar 2022: 0,86 %)		
Deutschland – 2,00 % (28. Februar 2022: 1,46 %)			300 TC Ziraat Bankasi AS, 144A, 5,125 %, fällig 29.09.2023	297	0,52
EUR 650 APCOA Parking Holdings GmbH, 4,625 %, fällig 15.01.2027	594	1,03	410 Turk Telekomunikasyon AS, 144A, 6,875 %, fällig 28.02.2025	388	0,67
EUR 360 APCOA Parking Holdings GmbH, 144A, 4,625 %, fällig 15.01.2027	329	0,57		685	1,19
EUR 240 TUI Cruises GmbH, 6,500 %, fällig 15.05.2026	227	0,40	Vereinigtes Königreich – 5,97 % (28. Februar 2022: 5,63 %)		
	1.150	2,00	GBP 220 Bellis Acquisition Co Plc, 4,500 %, fällig 16.02.2026	228	0,40
Gibraltar – 0,67 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			EUR 310 INEOS Quattro Finance 1 Plc, 3,750 %, fällig 15.07.2026	283	0,49
EUR 220 888 Acquisitions Ltd, 7,558 %, fällig 15.07.2027	200	0,35	GBP 250 Marks & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	273	0,47
EUR 200 888 Acquisitions Ltd, 144A, 7,558 %, fällig 15.07.2027	182	0,32	510 Marston's Issuer Plc, Series B1, 6,482 %, fällig 16.07.2035 *	482	0,84
	382	0,67	GBP 840 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	818	1,43
Guatemala – 1,14 % (28. Februar 2022: 0,48 %)			EUR 100 Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	87	0,15
490 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029 *	452	0,79	400 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	363	0,63
250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig 27.04.2031	202	0,35	560 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	464	0,81
	654	1,14	GBP 180 Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	184	0,32
Hongkong – 0,67 % (28. Februar 2022: 0,28 %)			GBP 240 Wheel Bidco Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2026	245	0,43
260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	216	0,38		3.427	5,97
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	166	0,29	USA – 36,14 % (28. Februar 2022: 34,87 %)		
	382	0,67	200 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028	160	0,28
Israel – 3,90 % (28. Februar 2022: 3,16 %)			150 American Airlines Group Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.03.2025	137	0,24
2.560 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	2.240	3,90	150 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	147	0,25
Italien – 1,71 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			110 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	107	0,19
920 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	694	1,21	660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	533	0,93
70 Telecom Italia Capital SA, 7,200 %, fällig 18.07.2036	62	0,11	280 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	271	0,47
230 Telecom Italia SpA/Milano, 144A, 5,303 %, fällig 30.05.2024	224	0,39	400 Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	329	0,57
	980	1,71	390 Ball Corp, 2,875 %, fällig 15.08.2030	312	0,53
Luxemburg – 3,83 % (28. Februar 2022: 1,90 %)			240 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	192	0,34
200 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2028	166	0,29	340 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	298	0,52
700 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	573	1,00	210 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	212	0,37
200 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	166	0,29	280 Carnival Corp, 144A, 10,500 %, fällig 01.06.2030	271	0,47
720 Altice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	502	0,87	230 Carnival Holdings Bermuda Ltd, 144A, 10,375 %, fällig 01.05.2028	246	0,43
390 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	319	0,55	EUR 500 Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029	267	0,46
220 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	228	0,40	620 Carriage Services Inc, 144A, 4,250 %, fällig 15.05.2029	499	0,87
260 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.08.2026	245	0,43	320 Carrols Restaurant Group Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	244	0,42
	2.199	3,83	1.840 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	1.379	2,40
Macau – 1,90 % (28. Februar 2022: 2,44 %)					
280 MGM China Holdings Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2027	247	0,43			
610 Sands China Ltd, 3,750 %, fällig 08.08.2031	482	0,84			
440 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2029	361	0,63			
	1.090	1,90			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Dominikanische Republik – 1,60 % (28. Februar 2022: 0,73 %)		
USA – (Fortsetzung)			Ecuador – 0,58 % (28. Februar 2022: 0,48 %)		
150 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	127	0,22	380 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	328	0,57
240 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	145	0,25	400 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 7,050 %, fällig 03.02.2031	400	0,70
230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	132	0,23	210 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 6,000 %, fällig 22.02.2033	191	0,33
380 CSC Holdings LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2030	205	0,36		919	1,60
870 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	464	0,81	Ägypten – 0,89 % (28. Februar 2022: 0,71 %)		
870 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	779	1,36	300 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 6,588 %, fällig 21.02.2028	235	0,41
230 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	216	0,38	350 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	276	0,48
270 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	210	0,37		511	0,89
280 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	166	0,29	Ghana – 0,45 % (28. Februar 2022: 0,60 %)		
300 DISH Network Corp, 2,375 %, fällig 15.03.2024	277	0,48	360 Internationale Anleihe der Regierung von Ghana, 144A, 10,750 %, fällig 14.10.2030	256	0,45
890 DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	573	1,00	Jordanien – 0,79 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
100 Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01.03.2031	69	0,12	440 Internationale Anleihe der jordanischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	453	0,79
120 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2030	115	0,20	Kenia – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,23 %)		
1.780 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	1.351	2,35	200 Internationale Anleihe der Republik Kenia, 144A, 7,250 %, fällig 28.02.2028	174	0,30
900 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 16.02.2028	753	1,31	Mexiko – 1,29 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
830 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	715	1,24	MXN 10.720 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	523	0,91
810 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.04.2026	782	1,36	MXN 4.680 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	220	0,38
150 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	144	0,25		743	1,29
550 Level 3 Financing Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	354	0,62	Nigeria – 0,40 % (28. Februar 2022: 0,34 %)		
740 Match Group Holdings II LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	580	1,01	300 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 144A, 7,875 %, fällig 16.02.2032	232	0,40
585 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	550	0,96	Russland – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,77 %)		
410 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 08.08.2026	355	0,62	RUB 69.969 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028 ty	47	0,08
580 NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	484	0,84	RUB 61.500 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029 ty	41	0,07
340 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028	207	0,36		88	0,15
340 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	297	0,52	Senegal – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
930 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	811	1,41	230 Internationale Anleihe der senegalesischen Regierung, 144A, 6,750 %, fällig 13.03.2048	162	0,28
520 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	469	0,82	Südafrika – 0,32 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
200 Service Properties Trust, 4,950 %, fällig 01.10.2029	158	0,27	250 Internationale Anleihe der Republik Südafrika, 5,650 %, fällig 27.09.2047	183	0,32
390 Sirius XM Radio Inc, 144A, 4,125 %, fällig 01.07.2030	317	0,55	Türkei – 1,46 % (28. Februar 2022: 1,70 %)		
320 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	275	0,48	960 Internationale Anleihe der türkischen Regierung, 4,250 %, fällig 14.04.2026	839	1,46
250 Spirit Airlines Inc, 1,000 %, fällig 15.05.2026	205	0,36	Ukraine – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,19 %)		
360 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	362	0,63	450 Internationale Anleihe der ukrainischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	87	0,15
80 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	80	0,14	USA – 14,05 % (28. Februar 2022: 0,08 %)		
520 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	377	0,66	100 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.09.2023	99	0,17
150 Suburban Propane Partners LP/Suburban Energy Finance Corp, 5,875 %, fällig 01.03.2027	143	0,25	500 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.12.2023	482	0,84
320 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	279	0,49	200 United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	193	0,34
190 Tenet Healthcare Corp, 6,250 %, fällig 01.02.2027	185	0,32	500 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	455	0,79
450 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	383	0,67	750 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	694	1,21
720 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	639	1,11	700 United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	661	1,15
120 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	103	0,18		2.584	4,50
230 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	118	0,20	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 13.807 \$)		
200 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	200	0,35	Schuldscheindarlehen – 0,31 % (28. Februar 2022: 3,22 %)		
	20.758	36,14	300 WW International Inc, 8,070 %, fällig 13.04.2028 *	174	0,31
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 49.751 \$)			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 221 \$)		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 17,71 % (28. Februar 2022: 14,64 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,23 % (28. Februar 2022: 7,76 %)		
Angola – 0,52 % (28. Februar 2022: 0,31 %)			EUR 1 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend		
330 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	297	0,52		133	0,23
Argentinien – 2,30 % (28. Februar 2022: 1,65 %)			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 138 \$)		
161 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	50	0,09		133	0,23
297 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,500 %, fällig 09.07.2030	97	0,17			
944 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,500 %, fällig 09.07.2035	271	0,47			
1.671 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 5,250 %, fällig 01.09.2037	640	1,11			
340 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	263	0,46			
	1.321	2,30			
Bahamas – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,23 %)					
200 Internationale Anleihe der Regierung der Bahamas, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024	193	0,34			
Bahrain – 0,43 % (28. Februar 2022: 0,32 %)					
310 Internationale Anleihe der Regierung von Bahrain, 144A, 6,000 %, fällig 19.09.2044	248	0,43			
Costa Rica – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
200 Internationale Anleihe der Regierung von Costa Rica, 6,125 %, fällig 19.02.2031	194	0,34			
Cote d'Ivoire (Ivory Coast) – 0,62 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
410 Internationale Anleihe der Regierung der Ivory Coast, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	356	0,62			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert	
Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
USA – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
4 EG Acquisition Corp	1	–	
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 4 \$)	1	–	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 64.168 \$)	52.716	91,79	
Devisenterminkontrakte – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	60	0,10	
Futures – 0,07 % (28. Februar 2022: 0,06 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	38	0,07	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	52.814	91,96	
Devisenterminkontrakte – -0,47 % (28. Februar 2022: -0,17 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-271	-0,47	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-271	-0,47	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	52.543	91,49	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	4.888	8,51	
Gesamt Nettovermögen	57.431 \$	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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 31.064.000 \$ und machten 54,09 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ε Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.

γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.

ABKÜRZUNGEN:

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

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund Sterling

MXN – Mexikanischer Peso

RUB – Russischer Rubel

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,17
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,30
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,23
Finanzderivate	0,17
Sonstige Vermögenswerte	9,13
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 159	Verkauf AUD 232	\$ 5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 61	Verkauf EUR 55	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 113	Verkauf GBP 93	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 27	Verkauf GBP 22	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 42	Verkauf SGD 57	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 3.219	Verkauf USD 3.891	-17
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 2.333	Verkauf USD 2.507	-38
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD –	Verkauf USD –	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 8.098	Verkauf USD 5.632	-180
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 2.377	Verkauf USD 1.794	-30
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 5	Verkauf USD 4	–
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 111	Verkauf EUR 102	2
18. Apr. 2023	Citi	Kauf USD 751	Verkauf EUR 695	15
18. Apr. 2023	Citi	Kauf EUR 100	Verkauf USD 108	-2
18. Apr. 2023	Citi	Kauf GBP 205	Verkauf USD 251	-4
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 2.607	Verkauf GBP 2.134	38
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 193 \$)				\$ 60
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -139 \$)				-271
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 54 \$)				\$ -211

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency März 2023	UBS	-23	\$ -3.045
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 51 \$)			\$ 38
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 51 \$)			\$ 38

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 14,21 % (28. Februar 2022: 14,64 %)					
China – 1,11 % (28. Februar 2022: 2,45 %)					
1.150	China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd, 3,080 %, Ewige Anleihe *	1.076	0,25		
2.500	Coastal Emerald Ltd, 4,300 %, Ewige Anleihe *	2.409	0,55		
2.100	Country Garden Holdings Co Ltd, 3,125 %, fällig 22.10.2025	1.358	0,31		
		4.843	1,11		
Frankreich – 1,32 % (28. Februar 2022: 1,49 %)					
SGD	8.000 Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	5.769	1,32		
Hongkong – 0,46 % (28. Februar 2022: 1,02 %)					
3.000	Panther Ventures Ltd, 3,500 %, Ewige Anleihe	2.025	0,46		
Indien – 0,80 % (28. Februar 2022: 1,92 %)					
4.000	REC Ltd, 2,250 %, fällig 01.09.2026	3.511	0,80		
Indonesien – 2,30 % (28. Februar 2022: 2,25 %)					
800	Freeport Indonesia PT, 4,763 %, fällig 14.04.2027	772	0,18		
3.000	Minejasa Capital BV, 5,625 %, fällig 10.08.2037	2.402	0,55		
3.350	Pelabuhan Indonesia Persero PT, 5,375 %, fällig 05.05.2045	3.093	0,71		
4.000	Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara, 4,125 %, fällig 15.05.2027	3.785	0,86		
		10.052	2,30		
Malaysia – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
SGD	3.000 Cagamas Global Plc, 3,850 %, fällig 11.09.2023	2.216	0,51		
Katar – 2,05 % (28. Februar 2022: 1,94 %)					
IDR	140.000.000 QNB Finance Ltd, 6,900 %, fällig 23.01.2025	8.959	2,05		
Singapur – 3,78 % (28. Februar 2022: 1,72 %)					
SGD	4.500 Mercatus Co-operative Ltd, Series DMTN, 2,800 %, fällig 26.07.2024	3.280	0,75		
SGD	11.500 Temasek Financial I Ltd, 2,800 %, fällig 17.08.2071	6.418	1,46		
7.000	United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Ewige Anleihe *	6.873	1,57		
		16.571	3,78		
Supranational – 1,46 % (28. Februar 2022: 1,38 %)					
IDR	20.000.000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,300 %, fällig 13.09.2023	1.298	0,29		
IDR	77.000.000 International Finance Corp, 8,000 %, fällig 09.10.2023	5.113	1,17		
		6.411	1,46		
Thailand – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,47 %)					
3.000	Thaioil Treasury Center Co Ltd, 3,500 %, fällig 17.10.2049	1.826	0,42		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 70.110 \$)					
		62.183	14,21		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 83,94 % (28. Februar 2022: 79,61 %)					
China – 17,35 % (28. Februar 2022: 23,15 %)					
CNY	110.000 Agricultural Development Bank of China, Series 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	17.157	3,92		
HKD	7.500 China Development Bank/Hong Kong, 4,303 %, fällig 24.01.2024 *	956	0,22		
CNY	33.000 Chinesische Staatsanleihe, 3,380 %, fällig 21.11.2024	4.810	1,10		
CNY	50.000 Chinesische Staatsanleihe, Series INBK, 2,680 %, fällig 21.05.2030	7.116	1,63		
CNY	96.500 Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	14.390	3,29		
CNY	100.000 Chinesische Staatsanleihe, Series INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	14.571	3,33		
CNY	5.000 Export-Import Bank of China/The, 4,400 %, fällig 14.05.2024	734	0,17		
CNY	40.000 Export-Import Bank of China/The, Series 2007, 3,260 %, fällig 24.02.2027	5.840	1,33		
CNY	30.000 Export-Import Bank of China/The, Series 1910, 3,860 %, fällig 20.05.2029	4.525	1,03		
CNY	40.000 Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig 23.03.2030	5.835	1,33		
		75.934	17,35		
Indien – 7,70 % (28. Februar 2022: 8,34 %)					
INR	280.000 Indische Staatsanleihe, 8,150 %, fällig 24.11.2026	3.461	0,79		
INR	750.000 Indische Staatsanleihe, Series SPB, 8,240 %, fällig 15.02.2027	9.309	2,13		
INR	400.000 Indische Staatsanleihe, 7,380 %, fällig 20.06.2027	4.822	1,10		
INR	450.000 Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	5.395	1,23		
INR	700.000 Indische Staatsanleihe, 7,610 %, fällig 09.05.2030	8.547	1,96		
INR	190.000 Indische Staatsanleihe, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2.149	0,49		
		33.683	7,70		
Indonesien – 10,13 % (28. Februar 2022: 8,21 %)					
IDR	51.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR77, 8,125 %, fällig 15.05.2024	3.414	0,78		
IDR	96.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026	6.685	1,53		
IDR	108.875.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	7.262	1,66		
IDR	20.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR47, 10,000 %, fällig 15.02.2028	1.508	0,34		
IDR	27.500.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR64, 6,125 %, fällig 15.05.2028	1.772	0,40		
IDR	100.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	6.449	1,47		
IDR	114.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR54, 9,500 %, fällig 15.07.2031	8.741	2,00		
IDR	25.000.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR58, 8,250 %, fällig 15.06.2032	1.800	0,41		
IDR	100.000.000 Lembaga Pembiayaan Ekspor Indonesia, Series OB, 8,250 %, fällig 15.08.2024	6.719	1,54		
		44.350	10,13		
Malaysia – 11,48 % (28. Februar 2022: 10,60 %)					
MYR	25.000 Malaysische Staatsanleihe, Series O115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	5.637	1,29		
MYR	1.200 Malaysische Staatsanleihe, Series O308, 5,248 %, fällig 15.09.2028	287	0,07		
MYR	26.850 Malaysische Staatsanleihe, Series O219, 3,885 %, fällig 15.08.2029	6.000	1,37		
MYR	78.000 Malaysische Staatsanleihe, Series O411, 4,232 %, fällig 30.06.2031	17.741	4,05		
MYR	51.780 Malaysische Staatsanleihe, Series O122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	11.226	2,56		
MYR	22.510 Malaysische Staatsanleihe, Series O413, 3,844 %, fällig 15.04.2033	4.938	1,13		
MYR	20.360 Malaysische Staatsanleihe, Series O419, 3,828 %, fällig 05.07.2034	4.428	1,01		
		50.257	11,48		
Philippinen – 4,92 % (28. Februar 2022: 9,17 %)					
PHP	1.256.000 Internationale Anleihe der philippinischen Regierung, 6,250 %, fällig 14.01.2036	21.554	4,92		
Singapur – 6,16 % (28. Februar 2022: 1,14 %)					
SGD	2.000 Housing & Development Board, 3,995 %, fällig 06.12.2029	1.490	0,34		
SGD	5.700 Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 03.03.2023	4.226	0,97		
SGD	10.000 Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 10.03.2023	7.409	1,69		
SGD	11.500 Monetary Authority of Singapore Bill, Series 87, Nullkupon, fällig 10.04.2023	8.491	1,94		
SGD	900 Monetary Authority of Singapore Bill, Series 84, Nullkupon, fällig 05.05.2023	663	0,15		
SGD	8.250 National Environment Agency, 2,500 %, fällig 15.09.2051	4.706	1,07		
		26.985	6,16		
Südkorea – 18,25 % (28. Februar 2022: 13,87 %)					
IDR	50.000.000 Export-Import Bank of Korea, 144A, 6,700 %, fällig 02.12.2024	3.268	0,75		
KRW	10.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Series 2409, 3,125 %, fällig 10.09.2024	7.483	1,71		
KRW	25.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Series 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	16.211	3,70		
KRW	46.300.000 Koreanische Schatzanleihe, Series 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	29.726	6,79		
KRW	22.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Series 3206, 3,375 %, fällig 10.06.2032	16.253	3,71		
KRW	13.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Series 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	6.937	1,59		
		79.878	18,25		
Thailand – 5,38 % (28. Februar 2022: 5,13 %)					
THB	801.030 Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	23.532	5,38		
USA – 2,23 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
5.400	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 15.12.2023	5.193	1,18		
5.500	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	4.587	1,05		
		9.780	2,23		
Vietnam – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
1.500	Internationale Anleihe der vietnamesischen Regierung, 4,800 %, fällig 19.11.2024	1.475	0,34		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 420.955 \$)					
		367.428	83,94		
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,88 % (28. Februar 2022: 2,41 %)					
3.862	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.862	0,88		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.862 \$)					
		3.862	0,88		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 494.927 \$)					
		433.473	99,03		
Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2022: 0,08 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	162	0,04		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		433.635	99,07		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom USD Nettoinventarwert
Devisenterminkontrakte: -0,26 % (28. Februar 2022: -0,12 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.130	-0,26
Futures – -0,09 % (28. Februar 2022: -0,22 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-373	-0,09
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.503	-0,35
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	432.132	98,72
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	5.575	1,28
Gesamtnettovermögen	437.707 \$	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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.268.000 \$ und machten 0,75 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ABKÜRZUNGEN:

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

CNY	– Chinesischer Renminbi
HKD	– Hongkong-Dollar
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 Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,33
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,87
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	1,76
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 664	Verkauf AUD 964	\$ 16
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 10	Verkauf CHF 10	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 120	Verkauf CNH 838	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 102	Verkauf CNH 695	2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 641	Verkauf EUR 597	7
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 57	Verkauf SGD 77	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 2.894	Verkauf USD 2.184	-37
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 10.747	Verkauf USD 11.552	-175
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CNH 26.081	Verkauf USD 3.846	-90
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 279	Verkauf USD 304	-7
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 21.725	Verkauf USD 15.108	-480
13. Juni 2023	Citi	Kauf USD 3.514	Verkauf AUD 5.000	137
13. Juni 2023	Citi	Kauf AUD 15.000	Verkauf USD 10.472	-341
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 378 \$)				\$ 162
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -594 \$)				-1.130
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -216 \$)				\$ -968

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Korea 10 Year Bond März 2023	UBS 124	\$ 10.289	\$ -373
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)			
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.113 \$)			
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.113 \$)			

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom USD Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom USD Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 83,61 % (28. Februar 2022: 86,23 %)			Niederlande – 5,25 % (28. Februar 2022: 4,36 %)		
Australien – 0,69 % (28. Februar 2022: 1,67 %)			EUR 3.000 ABN AMRO Bank NV, 0,875 %, fällig 15.01.2024		
EUR 720 Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, fällig 20.06.2029	624	0,12	EUR 220 ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025	221	0,04
EUR 3.000 Westpac Banking Corp, 0,625 %, fällig 22.11.2024	2.992	0,57	GBP 4.300 ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	5.090	0,97
	3.616	0,69	EUR 1.470 Alliantier NV, 2,625 %, fällig 09.09.2027	1.498	0,29
Kanada – 2,72 % (28. Februar 2022: 2,64 %)			GBP 2.500 Cooperatieve Rabobank UA, 1,250 %, fällig 14.01.2025	2.802	0,53
EUR 2.200 Bank of Nova Scotia/The, 0,500 %, fällig 30.04.2024	2.238	0,43	EUR 2.300 Cooperatieve Rabobank UA, 0,375 %, fällig 01.12.2027 *	2.104	0,40
GBP 1.230 Royal Bank of Canada, 1,375 %, fällig 09.12.2024	1.388	0,26	270 Cooperatieve Rabobank UA/NY, 3,375 %, fällig 21.05.2025	260	0,05
GBP 3.270 Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028	3.902	0,74	EUR 2,010 Enexis Holding NV, 0,750 %, fällig 02.07.2031	1.684	0,32
EUR 2.110 Toronto-Dominion Bank/The, 0,375 %, fällig 25.04.2024	2.149	0,41	EUR 300 ING Groep NV, 2,125 %, fällig 10.01.2026	303	0,06
GBP 1.980 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	2.181	0,42	EUR 1,300 ING Groep NV, 0,875 %, fällig 29.11.2030 *	1.081	0,21
GBP 2.000 Toronto-Dominion Bank/The, 5,288 %, fällig 11.01.2028	2.413	0,46	1.780 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 11.05.2025	1.715	0,33
	14.271	2,72	1.700 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	1.493	0,28
Dänemark – 2,09 % (28. Februar 2022: 1,91 %)			EUR 1,910 TenneT Holding BV, 1,625 %, fällig 17.11.2026	1.891	0,36
EUR 550 Danske Bank A/S, 0,875 %, fällig 22.05.2023	579	0,11	EUR 2,220 TenneT Holding BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	2.109	0,40
1.580 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	1.576	0,30	EUR 1,000 Vesteda Finance BV, 2,000 %, fällig 10.07.2026	988	0,19
GBP 2.890 Danske Bank A/S, 4,625 %, fällig 13.04.2027 *	3.407	0,65	EUR 1,500 Vesteda Finance BV, 0,750 %, fällig 18.10.2031	1.185	0,23
EUR 5.700 Nykredit Realkredit AS, 0,250 %, fällig 13.01.2026	5.367	1,03		27.527	5,25
	10.929	2,09	Norwegen – 1,69 % (28. Februar 2022: 0,80 %)		
Frankreich – 6,57 % (28. Februar 2022: 9,16 %)			EUR 940 Avinor AS, 0,750 %, fällig 01.10.2030	791	0,15
EUR 300 Air Liquide Finance SA, 1,000 %, fällig 02.04.2025	301	0,06	GBP 2,150 DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027 *	2.465	0,47
EUR 2.300 APRR SA, 0,125 %, fällig 18.01.2029	1.985	0,38	EUR 3,400 DNB Bank ASA, 3,125 %, fällig 21.09.2027 *	3.497	0,67
EUR 800 APRR SA, 1,500 %, fällig 25.01.2030	733	0,14	EUR 1,000 Equinor ASA, 0,750 %, fällig 22.05.2026	963	0,18
GBP 2.600 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 1,500 %, fällig 07.10.2026	2.765	0,53	EUR 540 Equinor ASA, 1,250 %, fällig 17.02.2027	518	0,10
230 BNP Paribas SA, 4,705 %, fällig 10.01.2025 *	228	0,04	EUR 620 Statkraft AS, 2,875 %, fällig 13.09.2029	629	0,12
EUR 2.700 BNP Paribas SA, 0,375 %, fällig 14.10.2027 *	2.480	0,47		8.863	1,69
EUR 1.100 BNP Paribas SA, 1,375 %, fällig 28.05.2029	969	0,18	Singapur – 1,06 % (28. Februar 2022: 0,19 %)		
GBP 2.600 BNP Paribas SA, 5,750 %, fällig 13.06.2032	3.155	0,60	EUR 5.300 Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig 15.02.2027	5.539	1,06
EUR 1.800 Bouygues SA, 4,625 %, fällig 07.06.2032	1.980	0,38	Spanien – 1,42 % (28. Februar 2022: 1,27 %)		
EUR 1.000 BPCE SA, 1,000 %, fällig 01.04.2025	994	0,19	EUR 2.000 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series gmtn, 3,375 %, fällig 20.09.2027	2.047	0,39
GBP 2.600 BPCE SA, 1,375 %, fällig 23.12.2026	2.719	0,52	GBP 500 Banco Santander SA, 2,750 %, fällig 12.09.2023	594	0,11
EUR 300 Credit Agricole SA/London, 1,250 %, fällig 14.04.2026	293	0,06	3.400 Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	3.333	0,64
6.350 Credit Agricole SA/London, 1,907 %, fällig 16.06.2026 *	5.830	1,11	EUR 1,700 Banco Santander SA, 0,625 %, fällig 24.06.2029 *	1.475	0,28
EUR 300 Credit Agricole SA/London, 1,750 %, fällig 05.03.2029	275	0,05		7.449	1,42
EUR 400 Engie SA, 1,000 %, fällig 13.03.2026	389	0,07	Supranational – 2,06 % (28. Februar 2022: 2,73 %)		
EUR 300 Engie SA, 2,375 %, fällig 19.05.2026	305	0,06	GBP 1.440 European Investment Bank, 0,750 %, fällig 14.07.2023	1.709	0,33
EUR 1,100 Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	897	0,17	GBP 6.300 Inter-American Development Bank, 0,500 %, fällig 15.09.2026	6.635	1,27
EUR 2,200 EssilorLuxottica SA, 0,000 %, fällig 27.05.2023	2.311	0,44	GBP 2.090 International Finance Facility for Immunisation Co, 2,750 %, fällig 07.06.2025	2.418	0,46
EUR 2,400 L'Oreal SA, 0,875 %, fällig 29.06.2026	2.344	0,45		10.762	2,06
EUR 600 RTE Reseau de Transport d'Electricite SADR, 1,000 %, fällig 19.10.2026	576	0,11	Schweden – 2,08 % (28. Februar 2022: 2,26 %)		
EUR 1,100 TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, fällig 04.03.2027	1.051	0,20	EUR 2.190 Hemo Treasury Oyj, 0,000 %, fällig 19.01.2028	1.858	0,35
GBP 1,700 Vinci SA, 2,250 %, fällig 15.03.2027	1.861	0,36	EUR 1.240 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,050 %, fällig 01.07.2024	1.249	0,24
	34.441	6,57	EUR 3.050 Swedbank AB, 0,250 %, fällig 09.10.2024	3.041	0,58
Deutschland – 5,72 % (28. Februar 2022: 6,50 %)			EUR 2.250 Swedbank AB, 0,300 %, fällig 20.05.2027 *	2.084	0,40
EUR 2.100 adidas AG, 0,000 %, fällig 09.09.2024	2.103	0,40	EUR 2.000 Vattenfall AB, 3,750 %, fällig 18.10.2026	2.115	0,40
EUR 900 Allianz Finance II BV, 0,000 %, fällig 14.01.2025	891	0,17	EUR 550 Volvo Treasury AB, 0,125 %, fällig 17.09.2024	549	0,11
EUR 700 Allianz Finance II BV, 1,500 %, fällig 15.01.2030	655	0,12		10.896	2,08
EUR 300 BASF SE, 0,875 %, fällig 15.11.2027	285	0,05	Schweiz – 3,77 % (28. Februar 2022: 4,87 %)		
EUR 600 Clearstream Banking AG, 0,000 %, fällig 01.12.2025	573	0,11	EUR 1.480 ABB Finance BV, 3,250 %, fällig 16.01.2027	1.544	0,29
EUR 500 Deutsche Börse AG, 1,125 %, fällig 26.03.2028	477	0,09	EUR 800 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	746	0,14
EUR 1,500 HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01.11.2028	1.299	0,25	GBP 3.530 Credit Suisse AG/London, 1,125 %, fällig 15.12.2025	3.642	0,69
GBP 6,000 Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,875 %, fällig 18.07.2024	6.857	1,31	500 Credit Suisse AG/New York NY, 3,625 %, fällig 09.09.2024	473	0,09
EUR 300 SAP SE, 1,750 %, fällig 22.02.2027	299	0,06	GBP 1,050 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 12.09.2025 *	1.145	0,22
GBP 1,200 Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 0,875 %, fällig 05.06.2023	1.429	0,27	EUR 180 Novartis Finance SA, 0,500 %, fällig 14.08.2023	188	0,04
EUR 4,000 Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 1,000 %, fällig 25.02.2030	3.577	0,68	EUR 6,000 Novartis Finance SA, 0,000 %, fällig 23.09.2028	5.242	1,00
EUR 3,700 Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 3,375 %, fällig 24.08.2031	3.855	0,74	EUR 2,400 UBS Group AG, 2,125 %, fällig 04.03.2024	2.502	0,48
EUR 200 Vier Gas Transport GmbH, 1,500 %, fällig 25.09.2028	187	0,04	4.430 UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027 *	4.291	0,82
EUR 360 Volkswagen Bank GmbH, 0,750 %, fällig 15.06.2023	378	0,07		19.773	3,77
EUR 920 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	937	0,18	Vereinigtes Königreich – 9,14 % (28. Februar 2022: 7,81 %)		
GBP 2,000 Volkswagen Financial Services NV, 5,500 %, fällig 07.12.2026	2.397	0,46	EUR 6.000 AstraZeneca Plc, 3,625 %, fällig 03.03.2027	6.333	1,21
EUR 2,200 Vonovia SE, 0,375 %, fällig 16.06.2027	1.959	0,37	GBP 1,700 British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	1.638	0,31
EUR 2,500 Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032	1.830	0,35	EUR 400 CK Hutchison Europe Finance 18 Ltd, 1,250 %, fällig 13.04.2025	397	0,08
	29.988	5,72	GBP 1,440 Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29.10.2025	1.562	0,30
Japan – 1,80 % (28. Februar 2022: 2,17 %)			EUR 270 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,250 %, fällig 21.05.2026	265	0,05
EUR 550 Mizuho Financial Group Inc, 1,598 %, fällig 10.04.2028	513	0,10	EUR 550 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,000 %, fällig 12.09.2026	534	0,10
EUR 2.150 Nidec Corp, 0,046 %, fällig 30.03.2026	2.021	0,38	EUR 5,000 GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, fällig 12.09.2029	4.609	0,88
EUR 3.370 NTT Finance Corp, 0,010 %, fällig 03.03.2025	3.307	0,63	EUR 1,200 GSK Capital BV, 3,125 %, fällig 28.11.2032	1.202	0,23
EUR 2.000 Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, fällig 23.10.2029	1.671	0,32	EUR 520 HSBC Holdings Plc, 0,875 %, fällig 06.09.2024	526	0,10
GBP 1.600 Toyota Motor Finance Netherlands BV, 4,625 %, fällig 08.06.2026	1.917	0,37	1.660 HSBC Holdings Plc, 3,803 %, fällig 11.03.2025 *	1.626	0,31
	9.429	1,80	390 HSBC Holdings Plc, 1,645 %, fällig 18.04.2026 *	357	0,07
Luxemburg – 0,41 % (28. Februar 2022: 0,59 %)			1.220 HSBC Holdings Plc, 2,099 %, fällig 04.06.2026 *	1.123	0,21
EUR 2.275 Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	2.125	0,41	EUR 1,630 HSBC Holdings Plc, Series GEN, 0,309 %, fällig 13.11.2026 *	1.548	0,30
			GBP 300 HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 22.07.2028 *	323	0,06
			EUR 2,100 Linde Plc, 1,000 %, fällig 31.03.2027	2.018	0,38
			EUR 1,000 Lloyds Banking Group Plc, 0,500 %, fällig 12.11.2025 *	996	0,19

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	537.641	102,60
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	-13.671	-2,60
Gesamtvermögen	523.970 \$	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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 9.744.000 \$ und machten 1,87 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ABKÜRZUNGEN:

EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,83
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,07
Finanzderivate	1,58
Sonstige Vermögenswerte	2,52
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch iTraxx Europe, 1,000 % – Verkauf		20. Dez. 2027	22.500	\$ 213
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ 213
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ 213

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 107	Verkauf AUD 160	\$ –
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 724	Verkauf EUR 678	8
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.315	Verkauf EUR 1.244	-4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.636	Verkauf GBP 2.175	15
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 3.618	Verkauf GBP 3.026	-21
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 348	Verkauf SEK 3.624	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 153	Verkauf SEK 1.612	-1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 14.602	Verkauf USD 10.155	-323
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 127.695	Verkauf USD 12.094	115
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 9.210	Verkauf USD 887	-7
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 241.586	Verkauf USD 291.972	-1.298
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 1.240	Verkauf USD 1.309	3
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 97.263	Verkauf USD 104.508	-1.534
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 1.222	Verkauf USD 1.467	3
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD 20.220	Verkauf EUR 18.812	232
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD 4.817	Verkauf GBP 4.000	-1
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD 9.693	Verkauf GBP 7.998	58
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD 33.913	Verkauf EUR 31.477	468
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD 12.992	Verkauf GBP 10.723	74
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD 720	Verkauf GBP 600	-2
16. Mai 2023	Citi	Kauf EUR 1.756	Verkauf USD 1.894	-28
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 14.006	Verkauf EUR 12.993	200
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 472	Verkauf GBP 390	3
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 807	Verkauf JPY 104.254	33
16. Mai 2023	HSBC	Kauf USD 26.768	Verkauf EUR 24.819	397
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 51.552	Verkauf EUR 47.825	737
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 9.973	Verkauf GBP 8.220	71
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 35.101	Verkauf EUR 32.568	497
16. Mai 2023	Royal Bank of Canada	Kauf USD 6.180	Verkauf GBP 5.106	29
16. Mai 2023	UBS	Kauf USD 37.021	Verkauf EUR 34.331	544
16. Mai 2023	UBS	Kauf USD 44.416	Verkauf GBP 36.688	219
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.176 \$)				\$ 3.707
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4.645 \$)				-3.219
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -469 \$)				\$ 488

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-634	\$ -77.238	\$ 2.071
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-255	-35.848	2.391
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-12	-12.925	138
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-146	-17.554	239
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	164	18.312	-4
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	142	15.202	-57
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.194 \$)				\$ 4.839
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -181 \$)				-61
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.013 \$)				\$ 4.778

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Italien – 0,74 % (28. Februar 2022: 0,60 %)					
EUR 1.100 UniCredit SpA, 1,200 %, fällig 20.01.2026 *	1.090	0,74	290 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	271	0,18
Luxemburg – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,34 %)					
EUR 620 Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	549	0,37	140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	117	0,08
EUR 100 Logicor Financing Sarl, 2,000 %, fällig 17.01.2034	72	0,05	110 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053	86	0,06
	621	0,42	110 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	88	0,06
Macau – 0,12 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	171	0,12	420 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	404	0,27
Mexiko – 0,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
130 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	122	0,08	230 Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	172	0,12
Niederlande – 0,97 % (28. Februar 2022: 1,25 %)					
EUR 200 ING Groep NV, 3,000 %, fällig 11.04.2028 *	212	0,14	130 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	117	0,08
EUR 900 ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	926	0,63	30 Citigroup Inc, 3,500 %, fällig 15.05.2023	30	0,02
80 Shell International Finance BV, 2,750 %, fällig 06.04.2030	70	0,05	290 Citigroup Inc, 1,750 %, fällig 28.01.2025	295	0,20
200 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	177	0,12	130 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	130	0,09
60 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	44	0,03	120 Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09.03.2026	117	0,08
	1.429	0,97	350 Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	336	0,23
Südafrika – 0,44 % (28. Februar 2022: 0,36 %)					
EUR 640 Anglo American Capital Plc, 1,625 %, fällig 18.09.2025	642	0,44	260 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	248	0,17
Schweden – 0,61 % (28. Februar 2022: 0,37 %)					
200 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 6,875 %, Ewige Anleihe *	196	0,13	230 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	200	0,14
EUR 660 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *	698	0,48	93 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	88	0,06
	894	0,61	85 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	75	0,05
Schweiz – 1,41 % (28. Februar 2022: 1,20 %)					
EUR 290 Credit Suisse Group AG, 3,250 %, fällig 02.04.2026 *	281	0,19	120 Comcast Corp, 4,000 %, fällig 01.03.2048	97	0,07
EUR 100 Credit Suisse Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *	85	0,06	66 Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	53	0,04
250 Credit Suisse Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	198	0,13	360 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	233	0,16
EUR 1.470 UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	1.508	1,03	51 Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	41	0,03
	2.072	1,41	57 Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	35	0,02
Vereinigte Arabische Emirate – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,81 %)					
530 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036	421	0,29	200 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	170	0,12
EUR 400 MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	315	0,21	360 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	256	0,17
	736	0,50	180 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	163	0,11
Vereinigtes Königreich – 2,96 % (28. Februar 2022: 2,26 %)					
GBP 670 Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14.11.2036 *	808	0,55	200 CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	135	0,09
GBP 100 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	110	0,08	390 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	350	0,24
GBP 100 BUPA Finance Plc, 5,000 %, fällig 25.04.2023	120	0,08	40 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	35	0,02
565 HSBC Holdings Plc, 4,250 %, fällig 18.08.2025	545	0,37	120 DISH DBS Corp, 5,875 %, fällig 15.11.2024	113	0,08
EUR 550 HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027 *	555	0,38	60 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	48	0,03
GBP 100 HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038	123	0,08	70 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029	41	0,03
1,000 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	1.264	0,86	20 Enterprise Products Operating LLC, 3,350 %, fällig 15.03.2023	20	0,01
GBP 260 Scottish Widows Ltd, 5,500 %, fällig 16.06.2023	313	0,21	180 Enterprise Products Operating LLC, 2,800 %, fällig 31.01.2030	154	0,10
EUR 140 Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	125	0,09	330 Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	303	0,21
460 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	381	0,26	10 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	10	0,01
	4.344	2,96	10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,01
USA – 15,12 % (28. Februar 2022: 14,08 %)					
EUR 100 3M Co, 3,700 %, fällig 15.04.2050	78	0,05	100 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	76	0,05
120 AbbVie Inc, 1,500 %, fällig 15.11.2023	125	0,08	310 Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	235	0,16
100 AbbVie Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2025	97	0,07	520 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	434	0,30
80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	71	0,05	20 Freepoint-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	18	0,01
120 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	110	0,07	70 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	70	0,05
320 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	267	0,18	10 General Motors Co, 5,200 %, fällig 01.04.2045	8	0,01
80 Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057	69	0,05	70 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	69	0,05
40 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	33	0,02	150 Gilead Sciences Inc, 4,800 %, fällig 01.04.2044	138	0,09
150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	117	0,08	30 Gilead Sciences Inc, 4,750 %, fällig 01.03.2046	27	0,02
184 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	152	0,10	110 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 01.04.2025	106	0,07
120 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	83	0,06	620 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	661	0,45
34 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	23	0,02	300 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	321	0,22
580 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	465	0,32	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	260	0,18
160 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	154	0,10	EUR 140 GSK Consumer Healthcare Capital NL BV, 1,750 %, fällig 29.03.2030	128	0,09
945 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	781	0,53	260 GSK Consumer Healthcare Capital US LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	227	0,15
610 Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	587	0,40	280 H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.12.2028	241	0,16
27 Becton Dickinson and Co, 3,734 %, fällig 15.12.2024	26	0,02	340 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	338	0,23
220 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	202	0,14	380 HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	374	0,25
130 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	96	0,06	200 HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	192	0,13
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	111	0,07	130 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	104	0,07
330 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	247	0,17	70 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	52	0,03
130 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	127	0,09	230 Home Depot Inc/The, 4,950 %, fällig 15.09.2052	221	0,15
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	55	0,04	20 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	15	0,01
			430 Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	443	0,30
			70 JPMorgan Chase & Co, 4,125 %, fällig 15.12.2026	68	0,05
			520 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	430	0,29
			440 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	370	0,25
			280 JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, fällig 14.09.2033 *	278	0,19
			30 McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	23	0,01
			110 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	92	0,06
			29 Medtronic Inc, 4,625 %, fällig 15.03.2045	27	0,02
			40 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	40	0,03
			10 Morgan Stanley, 4,431 %, fällig 23.01.2030 *	9	0,01
			260 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	230	0,16
			290 Morgan Stanley, 6,342 %, fällig 18.10.2033 *	306	0,21
			EUR 850 Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	838	0,57
			70 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2050	54	0,04
			EUR 380 Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, fällig 16.02.2032	290	0,20

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	USD			USD	USD	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)							
USA – (Fortsetzung)							
EUR	271	215	0,15				
	180	155	0,10				
	10	12	0,01				
	4	4	–				
	90	74	0,05				
	100	100	0,07				
	40	39	0,03				
	30	27	0,02				
	90	77	0,05				
	240	218	0,15				
	60	50	0,03				
	100	87	0,06				
	150	122	0,08				
	140	98	0,07				
	50	47	0,03				
	80	71	0,05				
	670	574	0,39				
	70	59	0,04				
	440	450	0,31				
	380	299	0,20				
	190	177	0,12				
	50	49	0,03				
	10	9	0,01				
	10	10	0,01				
	90	68	0,05				
	340	300	0,20				
	180	141	0,10				
	220	172	0,12				
	840	803	0,55				
	810	747	0,51				
		22.184	15,12				
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 48.153 \$)		41.904	28,56				
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 53,61 % (28. Februar 2022: 56,78 %)							
Belgien – 0,56 % (28. Februar 2022: 0,81 %)							
EUR	760	828	0,56				
Brasilien – 1,50 % (28. Februar 2022: 0,00 %)							
BRL	1.000	749	0,51				
BRL	9.000	1.455	0,99				
		2.204	1,50				
Kanada – 1,63 % (28. Februar 2022: 1,44 %)							
CAD	1.640	1.159	0,79				
CAD	1.030	667	0,46				
CAD	860	562	0,38				
		2.388	1,63				
Frankreich – 2,99 % (28. Februar 2022: 0,87 %)							
EUR	840	895	0,61				
EUR	1.670	1.336	0,91				
EUR	1.400	1.345	0,92				
EUR	870	615	0,42				
EUR	160	190	0,13				
		4.381	2,99				
Deutschland – 2,84 % (28. Februar 2022: 0,00 %)							
EUR	2.980	2.769	1,89				
EUR	1.430	1.400	0,95				
		4.169	2,84				
Indonesien – 1,19 % (28. Februar 2022: 2,60 %)							
IDR23.602.000		1.740	1,19				
Italien – 0,99 % (28. Februar 2022: 1,48 %)							
EUR	1.680	1.448	0,99				
Japan – 5,86 % (28. Februar 2022: 6,43 %)							
JPY	185.550	1.366	0,93				
JPY	78.450	573	0,39				
JPY	29.700	188	0,13				
JPY	536.600	3.068	2,09				
JPY	339.100	2.397	1,64				
JPY	143.700	1.002	0,68				
		8.594	5,86				
Mexiko – 4,03 % (28. Februar 2022: 3,78 %)							
MXN	83.640	3.922	2,67				
EUR	360	275	0,19				
	830	767	0,52				
	1.180	950	0,65				
		5.914	4,03				
Niederlande – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,00 %)							
EUR	970	751	0,51				
Polen – 1,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)							
PLN	12.700	1.942	1,32				
Südafrika – 1,55 % (28. Februar 2022: 1,61 %)							
ZAR	66.492	2.282	1,55				
Südkorea – 1,23 % (28. Februar 2022: 1,01 %)							
KRW	2.533.840	1.808	1,23				
Spanien – 1,44 % (28. Februar 2022: 2,07 %)							
EUR	500	623	0,43				
EUR	1.750	1.484	1,01				
		2.107	1,44				
Vereinigte Arabische Emirate – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,71 %)							
	890	735	0,05				
Vereinigtes Königreich – 5,56 % (28. Februar 2022: 2,24 %)							
GBP	4.620	5.795	3,95				
GBP	1.030	1.255	0,86				
GBP	710	609	0,41				
GBP	340	497	0,34				
		8.156	5,56				
USA – 19,91 % (28. Februar 2022: 29,33 %)							
	3.200	3.085	2,10				
	16.740	15.579	10,62				
	3.000	2.734	1,86				
	42	38	0,03				
	4.570	4.105	2,80				
	580	462	0,32				
	2.300	1.882	1,28				
	1.590	1.302	0,89				
	20	17	0,01				
		29.204	19,91				
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 91.180 \$)		78.651	53,61				
Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,65 % (28. Februar 2022: 10,08 %)							
	767	10.921	7,45				
	2	296	0,20				
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 10.882 \$)		11.217	7,65				
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 166.690 \$)		147.026	100,22				

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert
Gekaufte Optionen – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– U.S. 10 Year April 2023 Call 114.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	5	–
2.990 USD Call/MXN Put 19.25, fällig 14.04.2023 – JP Morgan	14	0,01
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 36 \$)	19	0,01
Devisenterminkontrakte – 0,69 % (28. Februar 2022: 0,89 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.011	0,69
Futures – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,41 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	338	0,23
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	148.394	101,15
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert
Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– U.S. 10 Year April 2023 Put 109.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-4	–
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -4 \$)	-4	–
Devisenterminkontrakte – -1,43 % (28. Februar 2022: -0,94 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.097	-1,43
Futures – -0,71 % (28. Februar 2022: -0,57 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.043	-0,71
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-3.144	-2,14
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	145.250	99,01
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.453	0,99
Gesamtnettovermögen	146.703 \$	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 Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.227.000 \$ und machten 5,61 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- ± Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 28. Februar 2023 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 2023.

ABKÜRZUNGEN:

- CPI – Verbraucherpreisindex.
- Ewige Anleihe – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
- TBA – Wird noch bekanntgegeben.
- BRL – Brasilianischer Real
- CAD – Kanadischer Dollar
- EUR – Euro
- GBP – Britisches Pfund Sterling
- IDR – Indonesische Rupiah
- JPY – Japanischer Yen
- KRW – Südkoreanischer Won
- 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	85,23
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,04
Finanzderivate	0,86
Sonstige Vermögenswerte	6,87
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
9. März 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf CNH	\$ -133
9. März 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf INR	4
9. März 2023	Citi	Kauf CNH	Verkauf USD	-12
9. März 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf CNH	-18
9. März 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf KRW	34
9. März 2023	JP Morgan	Kauf CNH	Verkauf USD	-1
9. März 2023	JP Morgan	Kauf KRW	Verkauf USD	-2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf CAD	25
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf NZD	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf NZD	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf NZD	Verkauf USD	-120
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD	Verkauf USD	-1.345
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	-354
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf PLN	17
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR	79
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP	22
16. Mai 2023	Citi	Kauf EUR	Verkauf USD	-10
16. Mai 2023	Citi	Kauf SEK	Verkauf USD	10
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf CAD	17
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf EUR	2
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf JPY	102
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf MXN	-11
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf USD	2
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY	Verkauf USD	–
16. Mai 2023	HSBC	Kauf USD	Verkauf EUR	180
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf AUD	4
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf CNH	55

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.575	Verkauf	EUR 1.461	23
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD 9.685	Verkauf	GBP 7.998	50
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD 180	Verkauf	GBP 150	-1
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.486	Verkauf	JPY 192.190	58
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 165.000	Verkauf	USD 1.245	-20
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	GBP 300	Verkauf	USD 364	-3
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 118	Verkauf	CAD 158	2
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 2.522	Verkauf	EUR 2.340	36
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 1.484	Verkauf	GBP 1.226	7
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD 3.140	Verkauf	JPY 406.780	119
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	AUD 2.280	Verkauf	USD 1.585	-46
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY 22.000	Verkauf	USD 170	-7
16. Mai 2023	UBS	Kauf	USD 9.616	Verkauf	EUR 8.917	141
16. Mai 2023	UBS	Kauf	USD 324	Verkauf	JPY 42.000	12
13. Juni 2023	Citi	Kauf	USD 10.683	Verkauf	CNH 73.790	-12
13. Juni 2023	Citi	Kauf	CNH 8.830	Verkauf	USD 1.276	4
13. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.609	Verkauf	CNH 11.110	-1
13. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	USD 1.942	Verkauf	KRW 2.554.455	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.797 \$)						\$ 1.011
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.907 \$)						-2.097
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -110 \$)						\$ -1.086

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	88	\$ 21.160	\$ -61
Australia 10 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	23	1.821	-22
Euribor 3 Month Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	84	21.460	-165
Euro-Bobl März 2023	Bank of America Merrill Lynch	81	9.868	-414
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	82	11.527	-311
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-7	-994	194
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-14	15.079	144
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	32	3.573	-1
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-84	-9.844	-13
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	124	13.275	-50
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	1	125	-
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	5	675	-6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 837 \$)				\$ 338
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.170 \$)				-1.043
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -333 \$)				\$ -705

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 13,07 % (28. Februar 2022: 4,40 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,21 % (28. Februar 2022: 0,93 %)		
Deutschland – 6,86 % (28. Februar 2022: 0,69 %)			559 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend) 559 1,21		
EUR 560	Bundesobligation, Series 182, 0,000 %, fällig 10.10.2025	549 1,19	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten 559 1,21		
EUR 270	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2025	272 0,59	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 51.996 \$) 43.765 95,04		
EUR 80	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2026	79 0,17	Devisenterminkontrakte – 0,74 % (28. Februar 2022: 1,07 %)		
EUR 200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2026	192 0,42	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 343 0,74		
EUR 420	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	402 0,87	Futures – 0,44 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
EUR 230	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.08.2027	221 0,48	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 202 0,44		
EUR 270	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2028	257 0,56	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 44.310 96,22		
EUR 70	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	65 0,14	Credit Default Swaps – -0,17 % (28. Februar 2022: -0,37 %)		
EUR 240	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	221 0,48	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -76 -0,17		
EUR 420	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	376 0,82	Devisenterminkontrakte – -0,19 % (28. Februar 2022: -0,15 %)		
EUR 160	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2031	136 0,30	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -90 -0,19		
EUR 60	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	76 0,17	Futures – -0,08 % (28. Februar 2022: -0,06 %)		
EUR 110	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 08, 4,750 %, fällig 04.07.2040	149 0,32	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -34 -0,08		
EUR 200	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,250 %, fällig 15.08.2048	161 0,35	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten -200 -0,44		
		3.156 6,86	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 44.110 95,78		
Indonesien – 0,63 % (28. Februar 2022: 0,47 %)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 1.940 4,22		
EUR 350	Internationale indonesische Staatsanleihe, 1,400 %, fällig 30.10.2031	291 0,63	Gesamt Nettovermögen 46.050 \$ 100,00		
Mexiko – 1,10 % (28. Februar 2022: 0,23 %)			– 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 %.		
620	Internationale mexikanische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 12.02.2034	507 1,10	144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 2.634.000 \$ und machten 5,71 % des Nettovermögens aus.		
Panama – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,23 %)			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.		
200	Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 2,252 %, fällig 29.09.2032	149 0,33	† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.		
Vereinigtes Königreich – 0,54 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			ε Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).		
GBP 100	United Kingdom Gilt, 0,125 %, fällig 30.01.2026	109 0,23			
GBP 140	United Kingdom Gilt, 0,125 %, fällig 31.01.2028	141 0,31			
		250 0,54			
USA – 3,61 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			ABKÜRZUNGEN:		
350	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	322 0,70	Ewige Anleihe – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
200	United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	194 0,42	EUR – Euro		
390	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	338 0,73	GBP – Britisches Pfund Sterling		
10	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	10 0,02			
120	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	118 0,26	Verteilung des Gesamtvermögens		
410	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	336 0,73	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 92,67		
180	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	151 0,33	Organismen für gemeinsame Anlagen 1,20		
190	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	194 0,42	Finanzderivate 1,17		
		1.663 3,61	Sonstige Vermögenswerte 4,96		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.627 \$) 6.016 13,07			Gesamtvermögen 100,00		

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2027	4.200	\$ -44
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2027	3.440	\$ -32
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -283 \$)				\$ -76
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -283 \$)				\$ -76

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	105	Verkauf	EUR	98	\$ 1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	GBP	–	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.283	Verkauf	USD	4.603	-69
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	16	Verkauf	USD	19	–
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf	USD	460	Verkauf	EUR	427	7
16. Mai 2023	Citi	Kauf	USD	965	Verkauf	EUR	896	13
16. Mai 2023	Citi	Kauf	USD	260	Verkauf	GBP	215	1
16. Mai 2023	Citi	Kauf	EUR	50	Verkauf	USD	54	-1
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	7.742	Verkauf	EUR	7.182	111
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.096	Verkauf	GBP	906	6
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR	820	Verkauf	USD	870	1
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	JPY	41.322	Verkauf	USD	320	-13
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	EUR	390	Verkauf	USD	421	-7
16. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	65	Verkauf	EUR	60	1
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD	5.541	Verkauf	EUR	5.139	81
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD	3.870	Verkauf	GBP	3.196	21
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.839	Verkauf	EUR	1.706	26
16. Mai 2023	Royal Bank of Canada	Kauf	USD	796	Verkauf	EUR	738	12
16. Mai 2023	UBS	Kauf	USD	3.628	Verkauf	EUR	3.364	53
16. Mai 2023	UBS	Kauf	USD	1.762	Verkauf	GBP	1.455	9
16. Mai 2023	UBS	Kauf	GBP	100	Verkauf	USD	120	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 827 \$)							\$	343
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -116 \$)								-90
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 711 \$)							\$	253

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
10 Year Mini Japanese Government Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-15	\$	-1.616	\$	14
Euro-Bobl März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-22		-2.680		101
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-6		-844		43
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-2		-2.154		23
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-9		-1.082		15
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	37		4.131		-1
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	34		3.640		-13
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-10		-1.252		6
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	20		2.701		-20
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 437 \$)					\$	202
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -44 \$)						-34
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 393 \$)					\$	168

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 4,57 % (28. Februar 2022: 4,54 %)			Irland – 0,02 % (28. Februar 2022: 0,10 %)		
11.500	10.753	0,50	250.000	3.046	0,14
9.070	8.470	0,40	500.000	6.100	0,28
13.950	13.257	0,62		21.431	1,00
6.590	5.753	0,27	Israel – 4,11 % (28. Februar 2022: 2,75 %)		
6.115	5.635	0,26	8.027	7.256	0,34
6.000	5.658	0,27	5.693	5.634	0,26
3.115	2.891	0,14	18.213	18.460	0,87
7.189	5.795	0,27	10.605	9.278	0,43
8.000	7.605	0,36	310	279	0,01
2.223	1.706	0,08	2.110	2.030	0,10
5.375	4.652	0,22	2.810	2.490	0,12
5.110	4.930	0,23	64.981	42.334	1,98
2.350	2.335	0,11		87.761	4,11
6.832	6.060	0,28	Italien – 0,13 % (28. Februar 2022: 0,09 %)		
7.200	6.706	0,31	2.950	2.816	0,13
6.000	5.279	0,25	Macau – 1,08 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 106.406 \$)			Malaysia – 0,39 % (28. Februar 2022: 0,39 %)		
	97.485	4,57	11.920	8.294	0,39
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,91 % (28. Februar 2022: 2,26 %)			Mexiko – 0,43 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
10.400	9.969	0,47	6.910	6.535	0,30
138	138	0,01	7.625	7.247	0,33
35	33	–	4.350	9.282	0,43
28	27	–	Supranational – 0,37 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
7.870	7.568	0,35	IDR 127,100,000	7.953	0,37
1.311	1.227	0,06	Schweden – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
461	414	0,02	4.400	3.777	0,18
Summe hypotheckenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 20.190 \$)			Schweiz – 2,18 % (28. Februar 2022: 1,62 %)		
	19.376	0,91	5.780	6.075	0,28
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 40,30 % (28. Februar 2022: 43,01 %)			Vereinigte Arabische Emirate – 0,37 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
Belgien – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,11 %)			Vereinigtes Königreich – 0,65 % (28. Februar 2022: 0,91 %)		
120	121	0,01	9.260	9.214	0,43
Bermudas – 0,61 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			USA – 26,93 % (28. Februar 2022: 28,67 %)		
14.150	13.031	0,61	520	393	0,02
Brasilien: 0,38 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			Altria Group Inc, 2,450 %, fällig 04.02.2032		
2.780	2.721	0,13	2.720	2.437	0,11
6.380	5.329	0,25	3.265	3.047	0,14
	8.050	0,38	557	483	0,02
Kanada – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,13 %)			Amazon.com Inc, 4,250 %, fällig 22.08.2057		
4.430	4.174	0,20	1.830	1.126	0,05
Kolumbien – 0,47 % (28. Februar 2022: 0,43 %)			Amazon.com Inc, 2,700 %, fällig 03.06.2060		
6.630	6.289	0,30	18.070	14.967	0,70
3.770	3.698	0,17	510	528	0,03
	9.987	0,47	560	518	0,02
Frankreich – 0,78 % (28. Februar 2022: 1,52 %)			Apache Corp, 5,100 %, fällig 01.09.2040		
4.590	3.785	0,18	4.550	3.694	0,17
200	157	0,01	Indien – 1,00 % (28. Februar 2022: 0,60 %)		
400	387	0,02	500.000	6.175	0,29
6.420	6.510	0,30	500.000	6.110	0,29
GBP 4.830	5.770	0,27			
	16.609	0,78			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			1 U.S. Bond April 2023 Call 126.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
USA – (Fortsetzung)			20.230 USD Put/INR Call 82.75, fällig 04.04.2023 – JP Morgan		
2.220	2.097	0,10	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 25.100 \$)	6.090	0,28
35.470	35.266	1,65	Credit Default Swaps – 0,27 % (28. Februar 2022: 0,27 %)		
500	359	0,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	5.762	0,27
2.570	1.672	0,08	Index-Swaps – 6,92 % (28. Februar 2022: 1,41 %)		
18.446	13.159	0,62	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	147.520	6,92
1.250	1.024	0,05	Zinsswaps – 0,12 % (28. Februar 2022: 3,64 %)		
16.910	14.220	0,67	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.585	0,12
59.810	60.894	2,85	Devisenterminkontrakte: 1,01 % (28. Februar 2022: 2,68 %)		
11.370	10.828	0,51	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	21.504	1,01
	299.540	14,05	Futures – 0,96 % (28. Februar 2022: 5,11 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	20.467	0,96
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.119.171	99,37
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.043.973 \$)	865.048	40,57	Kontrakte (in Tsd.)		
Schuldscheindarlehen – 1,98 % (28. Februar 2022: 1,85 %)			Verkaufte Optionen – -2,17 % (28. Februar 2022: -3,05 %)		
4.012	3.986	0,19	- 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Call 96.75, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-150	-0,01
1.428	1.427	0,07	-7 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Call 97.00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-3.192	-0,15
2.752	2.599	0,12	-3 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 95.3750, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.661	-0,08
6.065	6.066	0,28	- Australian Dollar Currency Future April 2023 Call 70.00, fällig 06.04.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-59	-
1.426	1.391	0,07	- Australian Dollar Currency Future März 2023 Call 70.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	-
1.333	1.333	0,06	- Australian Dollar Currency Future März 2023 Call 71.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1	-
5.622	5.189	0,24	- Australian Dollar Currency Future März 2023 Put 68.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-159	-0,01
1.608	1.603	0,08	- Australian Dollar Currency Future März 2023 Put 70.50, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.133	-0,05
1.322	1.300	0,06	- Australian Dollar Currency Future März 2023 Put 71.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-825	-0,04
5.714	5.711	0,27	- Euro Currency Future April 2023 Call 1.07, fällig 06.04.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-117	-0,01
2.514	2.411	0,11	- Euro Currency Future April 2023 Call 1.09, fällig 06.04.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-68	-
7.750	7.708	0,36	- Euro Currency Future April 2023 Call 1.10, fällig 06.04.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-31	-
1.550	1.523	0,07	- Euro Currency Future März 2023 Call 1.08, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	-
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 43.130 \$)	42.247	1,98	-1 Euro Currency Future März 2023 Call 1.09, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-4	-
Kommunalanleihen – 0,61 % (28. Februar 2022: 0,55 %)			- Euro Currency Future März 2023 Put 1.0750, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-902	-0,04
4.240	3.061	0,14	- Euro Currency Future März 2023 Put 1.08, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-582	-0,03
950	636	0,03	- Euro Currency Future März 2023 Put 1.09, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.748	-0,08
9.530	9.375	0,44	- Euro Currency Future März 2023 Put 1.0950, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.020	-0,05
Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 13.919 \$)	13.072	0,61	- Euro-Bund April 2023 Call 134.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-153	-0,01
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,87 % (28. Februar 2022: 3,96 %)			EUR -1 Euro-Bund April 2023 Call 135.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-294	-0,01
EUR 20 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	2.181	0,10	EUR -1 Euro-Bund April 2023 Call 136.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-360	-0,02
16.369 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	16.369	0,77	EUR - Euro-Bund April 2023 Call 136.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-26	-
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 18.642 \$)	18.550	0,87	EUR - Euro-Bund April 2023 Call 137.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-38	-
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 2.210.568 \$)	1.915.243	89,81	EUR -1 Euro-Bund April 2023 Call 137.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-115	-0,01
Gekaufte Optionen – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,67 %)			EUR -1 Euro-Bund April 2023 Call 138.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-65	-
2 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 96.00, fällig 15.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1.769	0,08	EUR - Euro-Bund April 2023 Put 135.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.669	-0,08
- Australian Dollar Currency Future März 2023 Call 69.50, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-	-	EUR - Euro-Bund April 2023 Put 136.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2.291	-0,11
1 Canadian Dollar Currency Future März 2023 Call 75.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	3	-	EUR - IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 95.50, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-23	-
- Canadian Dollar Currency Future März 2023 Call 75.50, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	1	-	EUR -4 IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 97.00, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-113	-0,01
- Euro Currency Future März 2023 Put 1.0850, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	722	0,03	EUR -6 IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 97.8750, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-78	-
EUR 1 Euro-Bund April 2023 Call 133.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	690	0,03	EUR -19 IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 98.00, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-233	-0,01
12 IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 97.1250, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch	311	0,01			
- U.S. 10 Year April 2023 Call 111.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	457	0,02			
- U.S. 10 Year April 2023 Put 111.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	194	0,01			
- U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	185	0,01			
- U.S. 5 Year April 2023 Call 107.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	148	0,01			
- U.S. Bond April 2023 Call 125.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	217	0,01			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Verkaufte Optionen – (Fortsetzung)					
– Japanese Yen Currency Future April 2023 Call 76.00, fällig 06.04.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-267	-0,01	-22.237 USD Put/BRL Call 5.2918, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	-293	-0,01
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Call 77.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	–	-22.630 USD Put/BRL Call 5.3073, fällig 16.05.2023 – Morgan Stanley	-731	-0,03
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Call 78.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	–	-22.380 USD Put/BRL Call 5.3682, fällig 06.04.2023 – Morgan Stanley	-763	-0,04
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Call 79.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2	–	-22.654 USD Put/MXN Call 19.25, fällig 07.03.2023 – Morgan Stanley	-1.117	-0,05
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Call 80.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1	–	Summe verkaufte Option (Anschaffungskosten -75.861 \$)	-46.352	-2,17
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Put 77.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-5.015	-0,24	Credit Default Swaps – -0,03 % (28. Februar 2022: -0,40 %)		
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Put 77.50, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.175	-0,06	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-520	-0,03
-4 U.S. 10 Year April 2023 Call 112.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2.408	-0,11	Index-Swaps – -0,92 % (28. Februar 2022: -0,04 %)		
-6 U.S. 10 Year April 2023 Call 113.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-2.203	-0,10	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-19.599	-0,92
-2 U.S. 10 Year April 2023 Call 113.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-614	-0,03	Zinsswaps – -1,07 % (28. Februar 2022: -4,88 %)		
– U.S. 10 Year April 2023 Call 114.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-39	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-22.883	-1,07
-1 U.S. 10 Year April 2023 Call 114.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-169	-0,01	Devisenterminkontrakte – -2,05 % (28. Februar 2022: -2,35 %)		
-3 U.S. 10 Year April 2023 Call 115.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-209	-0,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-43.616	-2,05
-4 U.S. 10 Year April 2023 Call 116.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-113	-0,01	Futures – -2,21 % (28. Februar 2022: -5,69 %)		
-1 U.S. 10 Year April 2023 Call 117.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-13	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-47.194	-2,21
-2 U.S. 10 Year April 2023 Put 113.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-3.127	-0,15	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-180.164	-8,45
– U.S. 10 Year April 2023 Put 115.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.567	-0,07	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.939.007	90,92
-1 U.S. 10 Year Juni 2023 Call 115.00, fällig 26.05.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-409	-0,02	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	193.494	9,08
-1 U.S. 10 Year W1 März 2023 Call 112.00, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-114	-0,01	Gesamt Nettovermögen	2.132.501 \$	100,00
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-227	-0,01	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 %.		
-3 U.S. 5 Year April 2023 Call 107.75, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.162	-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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 325.464.000 \$ und machten 15,25 % des Nettovermögens aus.		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Call 108.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-299	-0,01	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Call 108.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-177	-0,01	† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Call 108.75, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-79	–	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
-2 U.S. 5 Year April 2023 Call 109.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-214	-0,01	€ Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).		
-3 U.S. 5 Year April 2023 Call 109.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-127	-0,01	≠ Die Wertpapiere (in ihrer Gesamtheit oder in Teilen) sind zum 28. Februar 2023 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Call 109.75, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-44	–	γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.		
-3 U.S. 5 Year April 2023 Call 110.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-70	–	ABKÜRZUNGEN:		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Call 110.50, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-21	–	Ewige Anleihe – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
-1 U.S. 5 Year April 2023 Put 108.25, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-1.597	-0,07	REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit		
-1 U.S. Bond April 2023 Call 128.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-476	-0,02	AUD – Australischer Dollar		
-1 U.S. Bond April 2023 Call 130.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-330	-0,02	BRL – Brasilianischer Real		
-1 U.S. Bond April 2023 Call 132.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-141	-0,01	EGP – Ägyptisches Pfund		
– U.S. Bond April 2023 Call 134.00, fällig 24.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-13	–	EUR – Euro		
-22.237 USD Call/BRL Put 5.2918, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	-24	–	GBP – Britisches Pfund Sterling		
-22.630 USD Call/BRL Put 5.3073, fällig 16.05.2023 – Morgan Stanley	-691	-0,03	IDR – Indonesische Rupiah		
-22.380 USD Call/BRL Put 5.3682, fällig 06.04.2023 – Morgan Stanley	-318	-0,02	INR – Indische Rupie		
-22.750 USD Call/KRW Put 236.00, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	-1.465	-0,07	MXN – Mexikanischer Peso		
-22.750 USD Call/KRW Put 244.00, fällig 04.05.2023 – Morgan Stanley	-1.305	-0,06	PLN – Polnischer Zloty		
-22.360 USD Put/AUD Call 0.6990, fällig 30.03.2023 – Morgan Stanley	-57	–	RUB – Russischer Rubel		
-22.420 USD Put/BRL Call 5.00, fällig 22.03.2023 – Morgan Stanley	-48	–	ZAR – Südafrikanischer Rand		
					% des Gesamtvermögens
			Verteilung des Gesamtvermögens		
			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		74,64
			Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden		1,70
			Organismen für gemeinsame Anlagen		0,75
			Finanzderivate		8,21
			Sonstige Vermögenswerte		14,70
			Gesamtvermögen		100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2027	6.091	\$ 96
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2027	544.283	5.666
Bank of America Merrill Lynch	Teva Pharmaceutical Industries Ltd, 1,000 %	– Verkauf	20. Juni 2026	12.479	-520
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 11.462 \$)					\$ 5.762
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -16.749 \$)					-520
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -5.287 \$)					\$ 5.242

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,550 %	1. März 2025	2.219.704	\$ -18.619
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 11,993 %	4. Jan. 2027	496.488	-2.387
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIE Banxico, Receive Fixed 9,260 %	25. Okt. 2032	1.009.497	1.018
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,150 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Mai 2048	44.912	1.567
BNP Paribas	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,610 %	2. Jan. 2029	679.541	-1.794
JP Morgan	Pay Floating BRL CDI, Receive Fixed 12,893 %	2. Jan. 2029	73.048	-83
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 152.352 \$)				\$ 2.585
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -204.363 \$)				-22.883
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -52.011 \$)				\$ -20.298

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	143.464	\$ 19.396
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	213.642	27.954
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	26.146	7.901
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2047	32.688	9.258
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18. März 2032	35.169	4.463
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	111.770	15.781
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	12.230	1.747
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	227.407	29.105
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	34.210	4.265
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	61.775	3.286
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,220 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Mai 2032	420.344	14.456
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,250 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Sep. 2029	23.847	724
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	296.533	9.184
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	30. Juni 2029	97.359	-135
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 1,396 %	13. Okt. 2025	582.851	-12.143
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 3,400 %	21. Juni 2025	826.407	-4.766
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating USD SOFR Compound, Receive Fixed 4,600 %	4. Juni 2024	354.373	-2.555
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 58.980 \$)				\$ 147.520
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.721 \$)				-19.599
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 57.259 \$)				\$ 127.921

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 44.109	Verkauf BRL 228.318	\$ 500
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 228.318	Verkauf USD 44.880	-1.269
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 4.598	Verkauf AUD 6.638	129
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 6.225	Verkauf CHF 5.758	102
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 189	Verkauf CNH 1.299	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 76.495	Verkauf EUR 71.462	842
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 517	Verkauf EUR 489	-2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.288	Verkauf GBP 1.076	-9
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 3.509	Verkauf GBP 2.900	17
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.678	Verkauf JPY 356.964	51
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 10	Verkauf NOK 102	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.116	Verkauf NOK 11.468	10
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 52	Verkauf PLN 233	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 88	Verkauf SEK 920	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 50	Verkauf SEK 530	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.555	Verkauf SGD 3.410	25
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 25.527	Verkauf USD 27.823	-672
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 710	Verkauf USD 749	2

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CNH 27.699	Verkauf USD 4.084	\$ -95
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf JPY 7.513.435	Verkauf USD 57.397	-2.090
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 808.639	Verkauf USD 869.211	-13.093
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 65.186	Verkauf USD 45.331	-1.441
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf NOK 25	Verkauf USD 2	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf NOK 74.379	Verkauf USD 7.235	-65
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 8	Verkauf USD -	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 16.272	Verkauf USD 1.541	14
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf PLN 5.199	Verkauf USD 1.174	-6
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 72.596	Verkauf USD 87.732	-387
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 4	Verkauf USD 2	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 47	Verkauf USD 55	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 56.688	Verkauf USD 42.783	-727
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 450	Verkauf BRL 2.355	3
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 203.020	Verkauf USD 38.954	-443
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 47.299	Verkauf TWD 1.437.902	-139
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf KRW 27.950.786	Verkauf USD 21.960	-757
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf CNH 217.661	Verkauf USD 32.390	-967
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 9.238	Verkauf ZAR 168.753	89
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 77.685	Verkauf EUR 71.702	1.622
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf EUR 53.800	Verkauf USD 58.444	-1.371
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 22.443	Verkauf ZAR 410.453	188
18. Apr. 2023	Citi	Kauf USD 12.852	Verkauf EUR 11.800	334
18. Apr. 2023	Citi	Kauf USD 9.200	Verkauf JPY 1.183.000	450
18. Apr. 2023	Citi	Kauf JPY 750.000	Verkauf USD 5.880	-332
18. Apr. 2023	Citi	Kauf EUR 27.700	Verkauf USD 29.927	-542
18. Apr. 2023	Citi	Kauf GBP 1.900	Verkauf USD 2.302	-14
18. Apr. 2023	Citi	Kauf AUD 28.500	Verkauf USD 20.258	-1.047
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 289.517	Verkauf JPY 37.849.029	9.550
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 107.152	Verkauf MXN 2.120.970	-7.668
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf ZAR 593.428	Verkauf USD 34.646	-2.470
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 21.043	Verkauf BRL 109.222	369
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 213.644	Verkauf CNH 1.463.389	2.380
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 20.222	Verkauf COP 98.621.820	129
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 100.560	Verkauf IDR 1.571.371.091	-2.375
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 88.349	Verkauf INR 7.358.629	-362
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 22.721	Verkauf KRW 27.950.786	1.517
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf SGD 45.121	Verkauf USD 33.776	-271
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CAD 51.338	Verkauf USD 38.440	-797
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CNH 1.089.996	Verkauf USD 161.049	-3.691
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf IDR 142.957.783	Verkauf USD 9.190	174
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf INR 1.081.792	Verkauf USD 13.079	-37
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf BRL 175.606	Verkauf USD 32.788	452
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 27.764	Verkauf AUD 39.819	922
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 33.157	Verkauf EUR 31.219	39
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 60.865	Verkauf GBP 49.830	871
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 65.320	Verkauf PLN 291.145	101
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf PLN 49.302	Verkauf USD 11.005	39
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf MYR 49.444	Verkauf USD 11.383	-337
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf NOK 36.790	Verkauf USD 3.692	-140
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf GBP 6.674	Verkauf USD 8.025	10
20. Sep. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 4.667	Verkauf RUB 338.380	572
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 112.006 \$)				\$ 21.504
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -98.156 \$)				-43.616
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 13.850 \$)				\$ -22.112

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	-494	\$ -117.016	\$ 970
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	-2.262	-543.898	2.559
3 Month SOFR Index Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	504	119.228	-2.446
3 Month SOFR Index September 2023	Bank of America Merrill Lynch	4.122	974.801	-6.826
90 Day Euro\$ März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-2.098	-497.895	-57
Australian Dollar Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.618	109.013	-2.436
British Pound Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	520	39.185	-1.054
Canadian Dollar Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	167	12.255	-105

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte – (Fortsetzung)

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euribor 3 Month Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	2.418	\$ 614.476	\$ -5.930
Euro FX Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	504	66.730	-1.936
Euro-Bund Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	75	10.467	-45
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	698	98.124	-3.398
Fed Fund 30 Day Februar 2023	Bank of America Merrill Lynch	-1.147	-456.100	-62
Fed Fund 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-594	-639.787	3.317
Japanese Yen Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.665	337.134	-12.180
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	264	31.743	-157
Mexican Peso Currency März 2023	Bank of America Merrill Lynch	4.030	109.737	5.766
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	27.440	3.063.848	-892
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-16.192	-1.897.500	-2.376
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-13.633	-2.777.404	7.855
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-6.378	-682.795	-1.106
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	14.483	1.813.543	-1.793
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	3.516	474.880	-4.395
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 213.705 \$)				\$ 20.467
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -237.864 \$)				-47.194
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -24.159 \$)				\$ -26.727

[^] 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 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 14,21 % (28. Februar 2022: 9,77 %)								
69	ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1, Class A3, 144A, 5,297 %, fällig 25.04.2033 *	64	0,02	630	National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class B, 4,997 %, fällig 26.03.2035 *	520	0,19	
1.274	ACE Securities Corp Home Equity Loan Trust Series 2005-HE3, Series 2005 HE3, Class M4, 5,562 %, fällig 25.05.2035 *	1.137	0,41	77	National Collegiate Student Loan Trust 2006-1, Series 2006 1, Class A5, 4,967 %, fällig 25.03.2033 *	72	0,03	
669	Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Cfts Ser 2005-4, Series 2005 4, Class M2, 5,322 %, fällig 25.10.2035 *	621	0,23	790	National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 4,977 %, fällig 26.01.2032 *	615	0,22	
950	AGL CLO 12 Ltd, Series 2021 12A, Class D, 144A, 7,658 %, fällig 20.07.2034 *	893	0,33	839	National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Series 2007 2, Class A4, 4,907 %, fällig 25.01.2033 *	776	0,28	
400	Ammc Clo 20 Ltd, Series 2017 20A, Class E, 144A, 10,602 %, fällig 17.04.2029 *	385	0,14	1.302	National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	339	0,12	
450	Anchorage Capital CLO 3-R Ltd, Series 2014 3RA, Class E, 144A, 10,302 %, fällig 28.01.2031 *	388	0,14	2.291	National Collegiate VI 2007-4 Class A-3L Commutation Trust, Series 2007 4VI, Class O, 144A, 5,356 %, fällig 29.03.2038 *†	448	0,16	
480	Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Series 2022 2A, Class D1, 144A, 8,303 %, fällig 22.04.2035 *	443	0,16	1.000	Ocean Trails CLO V, Series 2014 5A, Class DRR, 144A, 8,265 %, fällig 13.10.2031 *	854	0,31	
660	Bain Capital Credit CLO 2023-1 Ltd, Series 2023 1A, Class AN, 144A, 0,000 %, fällig 16.04.2036 *	660	0,24	650	OCTAGON INVESTMENT PARTNERS 35 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 7,408 %, fällig 20.01.2031 *	588	0,21	
1.380	Ballyrock CLO 19 Ltd, Series 2022 19A, Class D, 144A, 11,749 %, fällig 20.04.2035 *	1.264	0,46	940	Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M4, 5,547 %, fällig 25.08.2035 *	748	0,27	
1.225	Ballyrock CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class C, 144A, 7,958 %, fällig 20.04.2031 *	1.168	0,43	267	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 1A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	217	0,08	
720	Barings CLO Ltd 2016-II, Series 2016 2A, Class ER2, 144A, 11,308 %, fällig 20.01.2032 *	663	0,24	546	Option One Mortgage Loan Trust 2007-FXD1, Series 2007 FXD1, Class 2A1, 5,866 %, fällig 25.01.2037	458	0,17	
500	Black Diamond Clo 2019-2 Ltd, Series 2019 2A, Class A1A, 144A, 6,245 %, fällig 23.07.2032 *	492	0,18	678	RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3, Class M1, 5,127 %, fällig 25.03.2036 *	654	0,24	
441	Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class AA, 144A, 2,487 %, fällig 16.12.2041	406	0,15	80	RBSSP Resecuritization Trust 2010-4, Series 2010 4, Class 6A2, 144A, 5,825 %, fällig 26.02.2036	77	0,03	
1.000	BlueMountain CLO XXII Ltd, Series 2018 22A, Class A1, 144A, 5,872 %, fällig 15.07.2031 *	991	0,36	1.320	Saranac CLO III Ltd, Series 2014 3A, Class DR, 144A, 8,003 %, fällig 22.06.2030 *	1.178	0,43	
720	CarVal CLO VII-C Ltd, Series 2023 1A, Class A1, 144A, 6,883 %, fällig 20.01.2035 *	721	0,26	320	SMB Private Education Loan Trust 2015-C, Series 2015 C, Class C, 144A, 4,500 %, fällig 17.09.2046	296	0,11	
255	CWABS Revolving Home Equity Loan Trust Series 2004-B, Series 2004 B, Class 2A, 4,808 %, fällig 15.02.2029 *	227	0,08	858	Structured Asset Investment Loan Trust 2004-2, Series 2004 2, Class A4, 5,322 %, fällig 25.03.2034 *	811	0,29	
19	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, Series 2005 D, Class 2A, 4,778 %, fällig 15.11.2035 *	18	0,01	1.170	Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class A, 144A, 5,310 %, fällig 30.04.2049	1.111	0,40	
698	Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Class B, 144A, 4,250 %, fällig 20.12.2038	642	0,23	540	Symphony CLO 37 Ltd, Series 2022 37A, Class A1A, 144A, 6,546 %, fällig 20.10.2034 *	541	0,20	
531	Educational Funding Co LLC/The, Series 2006 1A, Class A3, 144A, 5,168 %, fällig 25.04.2033 *	370	0,13	500	Venture XVII CLO Ltd, Series 2014 17A, Class ERR, 144A, 10,532 %, fällig 15.04.2027 *	426	0,16	
660	Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M4, 5,547 %, fällig 25.11.2035 *	604	0,22	750	Voya CLO 2016-3 Ltd, Series 2016 3A, Class A1R, 144A, 5,985 %, fällig 18.10.2031 *	745	0,27	
78	First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Series 2003 FF4, Class M1, 6,366 %, fällig 25.10.2033 *	74	0,03	1.000	Voya CLO 2017-1 Ltd, Series 2017 1A, Class C, 144A, 8,122 %, fällig 17.04.2030 *	923	0,34	
1.131	FOCUS Brands Funding LLC, Series 2017 1A, Class A2II, 144A, 5,093 %, fällig 30.04.2047	1.026	0,37	200	VOYA CLO 2017-2, Series 2017 2A, Class D, 144A, 10,812 %, fällig 07.06.2030 *	173	0,06	
540	F5 Rialto 2022-FL6 Issuer LLC, Series 2022 FL6, Class A, 144A, 7,144 %, fällig 17.08.2037 *	541	0,20	660	WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4, Class 1A, 4,787 %, fällig 25.07.2047 *	477	0,17	
1.000	Golub Capital Partners CLO 21M Ltd, Series 2014 21A, Class CR, 144A, 7,268 %, fällig 25.01.2031 *	961	0,35	600	Wellfleet CLO 2017-3 Ltd, Series 2017 3A, Class C, 144A, 7,542 %, fällig 17.01.2031 *	522	0,19	
1.000	Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class E, 144A, 11,508 %, fällig 20.07.2034 *	908	0,33	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 41.801 \$)			39.064	14,21
139	GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class A, 144A, 1,930 %, fällig 20.07.2048	106	0,04	Forderungsbesicherte Wertpapiere – 12,42 % (28. Februar 2022: 10,09 %)				
250	Greenwood Park CLO Ltd, Series 2018 1A, Class E, 144A, 9,742 %, fällig 15.04.2031 *	210	0,08	286	Alternative Loan Trust 2007-4CB, Series 2007 4CB, Class 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	241	0,09	
1.000	Grippen Park CLO Ltd, Series 2017 1A, Class D, 144A, 8,108 %, fällig 20.01.2030 *	939	0,34	202	BAMLL Re-REMIC Trust 2016-RGG10, Series 2016 GG10, Class AJA, 144A, 5,648 %, fällig 10.08.2045 *	52	0,02	
1.372	Hardee's Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,981 %, fällig 20.12.2050	1.191	0,43	577	Banc of America Funding Corp, Series 2015 R3, Class 1A2, 144A, 1,895 %, fällig 27.03.2036 *	469	0,17	
1.400	Harriman Park CLO Ltd, Series 2020 1A, Class ER, 144A, 11,208 %, fällig 20.04.2034 *	1.239	0,45	780	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A4, 3,175 %, fällig 15.09.2060	715	0,26	
145	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class C, 144A, 6,290 %, fällig 16.06.2036 *	136	0,05	140	BCCRE Trust 2015-GTP, Series 2015 GTP, Class D, 144A, 4,563 %, fällig 10.08.2033 *	122	0,04	
170	HGI CRE CLO 2021-FL1 Ltd, Series 2021 FL1, Class D, 144A, 6,940 %, fällig 16.06.2036 *	160	0,06	840	BBSG 2016-MRP Mortgage Trust, Series 2016 MRP, Class A, 144A, 3,275 %, fällig 05.06.2036	669	0,24	
584	Home Equity Asset Trust 2006-4, Series 2006 4, Class 2A4, 5,177 %, fällig 25.08.2036 *	570	0,21	510	BHMS 2018-ATLS, Series 2018 ATLS, Class C, 144A, 6,488 %, fällig 15.07.2035 *	491	0,18	
750	Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INABS 2005-C, Series 2005 C, Class M2, 5,367 %, fällig 25.10.2035 *	730	0,27	520	BX Trust 2021-VIEW, Series 2021 VIEW, Class C, 144A, 6,938 %, fällig 15.06.2036 *	491	0,18	
500	LCM XXII Ltd 22A, Class DR, 144A, 10,308 %, fällig 20.10.2028 *	424	0,15	784	BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 5,578 %, fällig 15.02.2038 *	775	0,28	
244	Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M4, 5,892 %, fällig 25.02.2035 *	236	0,09	480	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	441	0,16	
1.000	Magnetite XII Ltd, Series 2015 12A, Class ER, 144A, 10,472 %, fällig 15.10.2031 *	912	0,33	11.117	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class XA, 0,871 %, fällig 15.09.2050 *	337	0,12	
1.270	Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 8,338 %, fällig 20.01.2032 *	1.101	0,40	383	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Series 2018 C5, Class A3, 3,963 %, fällig 10.06.2051	355	0,13	
548	Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Series 2007 HE2, Class A1, 5,767 %, fällig 25.08.2037 *	458	0,17	710	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class C, 4,297 %, fällig 10.02.2048 *	624	0,23	
331	Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043 ∞	202	0,07	360	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 8,017 %, fällig 25.10.2039 *	358	0,13	
1.336	Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Series 2022 1A, Class B, 144A, 3,160 %, fällig 20.01.2053	1.109	0,40	670	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1M2, 144A, 6,034 %, fällig 25.10.2041 *	655	0,24	
710	National Collegiate II Commutation Trust, Series 2005 AR15, Class AR15, 0,000 %, fällig 01.06.2045	105	0,04	190	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 7,234 %, fällig 25.12.2041 *	178	0,07	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
330	282	0,10	790	663	0,24
1.480	788	0,29	472	436	0,16
630	592	0,22	250	26	0,01
618	503	0,18	410	16	0,01
700	697	0,25	370	1	–
790	823	0,30	853	837	0,30
630	669	0,24	834	810	0,29
950	991	0,36	891	854	0,31
2.500	2.409	0,88	63	56	0,02
100	98	0,04	105	67	0,02
520	508	0,18	2.326	1.865	0,68
500	527	0,19	326	291	0,11
680	663	0,24	130	114	0,04
570	540	0,20	743	681	0,25
450	467	0,17	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 38.274 \$)		
164	89	0,03	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 59,17 % (28. Februar 2022: 52,04 %)		
380	381	0,14	Argentinien – 0,35 % (28. Februar 2022: 0,55 %)		
462	200	0,07	410	385	0,14
60	53	0,02	290	260	0,09
330	299	0,11	420	329	0,12
1.242	932	0,34	Belgien – 0,37 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
1.010	–	–	EUR	1.027	0,37
2	2	–	Bermudas – 0,38 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
1.300	991	0,36	1.130	1.041	0,38
84	73	0,03	Brasilien – 1,03 % (28. Februar 2022: 1,59 %)		
281	124	0,05	460	382	0,14
31	8	–	550	496	0,18
31	8	–	370	286	0,10
500	476	0,17	690	576	0,21
381	335	0,12	800	631	0,23
159	116	0,04	450	460	0,17
880	722	0,26	Kanada – 2,18 % (28. Februar 2022: 1,96 %)		
361	279	0,10	780	703	0,26
726	659	0,24	250	226	0,08
254	228	0,08	CAD	280	0,10
441	371	0,14	865	829	0,30
263	258	0,09	380	338	0,12
610	602	0,22	280	252	0,09
1.226	1.102	0,40	390	345	0,13
			440	447	0,16
			1.050	980	0,36
			140	121	0,04
			270	223	0,08
			250	217	0,08
			250	256	0,09
			860	784	0,29
			Cayman Islands – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
			1.274	1.153	0,42
			Chile – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,25 %)		
			803	568	0,21

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Niederlande – 0,48 % (28. Februar 2022: 0,42 %)		
China – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,32 %)			EUR 1,000 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, Ewige Anleihe *		
400 Country Garden Holdings Co Ltd, 8,000 %, fällig 27.01.2024	349	0,13	EUR 310 Stichting AK Rabobank Certificaten, 6,500 %, Ewige Anleihe	323	0,12
200 Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	199	0,07		1.310	0,48
370 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	284	0,10			
	832	0,30	Puerto Rico – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Dänemark – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			80 Liberty Latin America Ltd, 2,000 %, fällig 15.07.2024		
800 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig 09.01.2026 *	805	0,29		74	0,03
Frankreich – 0,74 % (28. Februar 2022: 0,38 %)			Singapur – 0,08 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
200 Altice France SA/France, 144A, 8,125 %, fällig 01.02.2027	187	0,07	220 Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig 19.06.2024		
550 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	562	0,20		216	0,08
1.270 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	1.288	0,47	Südafrika – 0,09 % (28. Februar 2022: 0,25 %)		
	2.037	0,74	310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18.03.2031		
Deutschland – 0,78 % (28. Februar 2022: 0,21 %)			Schweiz – 1,75 % (28. Februar 2022: 0,27 %)		
320 Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2028	283	0,10	250 Credit Suisse AG/New York NY, 1,000 %, fällig 05.05.2023		
120 Mercer International Inc, 5,125 %, fällig 01.02.2029	99	0,04	700 Credit Suisse Group AG, 144A, 6,537 %, fällig 12.08.2033 *		
EUR 100 Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	104	0,04	500 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,016 %, fällig 15.11.2033 *		
1.733 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig 29.04.2025	1.657	0,60	200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, Ewige Anleihe *†		
	2.143	0,78	910 Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, Ewige Anleihe *†		
Guatemala – 0,11 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			200 Credit Suisse Group AG, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *†		
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27.04.2031	293	0,11	1.500 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe *		
Hongkong – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,17 %)			390 VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2027		
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 06.06.2025	187	0,07	440 VistaJet Malta Finance Plc / XO Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2030		
730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	606	0,22		4.805	1,75
	793	0,29	Vereinigte Arabische Emirate – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
Irland – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,20 %)			660 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048		
630 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	505	0,19		639	0,23
420 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 15.04.2026	390	0,14	Vereinigtes Königreich – 1,64 % (28. Februar 2022: 2,09 %)		
	895	0,33	210 Barclays Plc, 7,750 %, Ewige Anleihe *		
Israel – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,53 %)			EUR 320 Lloyds Banking Group Plc, 4,947 %, Ewige Anleihe *		
1.230 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	1.112	0,40	250 Lloyds Banking Group Plc, 7,500 %, Ewige Anleihe *		
300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	270	0,10	242 Mclaren Finance Plc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2026		
	1.382	0,50	GBP 970 NatWest Group Plc, 4,500 %, Ewige Anleihe *		
Italien – 0,46 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			690 Neptune Energy Bondco Plc, 144A, 6,625 %, fällig 15.05.2025		
230 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	220	0,08	GBP 800 Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026		
530 UniCredit SpA, 144A, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	500	0,18	950 Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029		
640 UniCredit SpA, 144A, 5,459 %, fällig 30.06.2035 *	544	0,20	330 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031		
	1.264	0,46	4.508		
Kasachstan – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,52 %)			USA – 42,60 % (28. Februar 2022: 37,58 %)		
380 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 4,750 %, fällig 19.04.2027	349	0,13	720 Abercrombie & Fitch Management Co, 144A, 8,750 %, fällig 15.07.2025		
230 KazTransGas JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027	208	0,07	1.103 Accelerate360 Holdings LLC, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2028		
	557	0,20	330 Acuris Finance US Inc / Acuris Finance SARL, 144A, 5,000 %, fällig 01.05.2028		
Kuwait – 0,27 % (28. Februar 2022: 0,27 %)			630 AdapthHealth LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2028		
730 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18.05.2030	747	0,27	286 Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028		
Luxemburg – 0,94 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			690 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030		
1.650 Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	1.364	0,50	447 Akumin Escrow Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2028		
500 ARD Finance SA, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	410	0,15	300 Akumin Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2025		
GBP 570 Cidron Aida Finco Sarl, 6,250 %, fällig 01.04.2028	591	0,21	240 Alcoa Nederland Holding BV, 144A, 6,125 %, fällig 15.05.2028		
220 FAGE International SA / FAGE USA Dairy Industry Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.08.2026	207	0,08	1.310 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028		
	2.572	0,94	300 Allied Universal Holdco LLC / Allied Universal Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.07.2026		
Macau – 0,82 % (28. Februar 2022: 0,44 %)			40 Altria Group Inc, 2,450 %, fällig 04.02.2032		
270 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig 08.08.2025	262	0,09	340 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049		
200 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig 08.08.2028	189	0,07	170 AMC Entertainment Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.02.2029		
200 Sands China Ltd, 3,350 %, fällig 08.03.2029	164	0,06	324 American Airlines 2017-1 Class B Pass Through Trust, Series B, 4,950 %, fällig 15.02.2025		
200 Sands China Ltd, 3,750 %, fällig 08.08.2031	158	0,06	71 American Airlines 2017-2 Class B Pass Through Trust, Series B, 3,700 %, fällig 15.10.2025		
1.550 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024	1.483	0,54	190 American Airlines Inc, 144A, 11,750 %, fällig 15.07.2025		
	2.256	0,82	430 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028		
Malaysia – 0,12 % (28. Februar 2022: 0,19 %)			30 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026		
490 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	341	0,12	720 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029		
Mexiko – 0,35 % (28. Februar 2022: 0,41 %)			1.162 American News Co LLC, 144A, 8,500 %, fällig 01.09.2026		
1.020 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *	957	0,35	190 Antero Resources Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2030		
			350 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 5,375 %, fällig 15.10.2023		
			130 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029		

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
450 Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	370	0,13	490 Sunnova Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.09.2026	428	0,16
440 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	367	0,13	260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	225	0,08
660 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	497	0,18	1.010 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	918	0,33
560 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 6,500 %, fällig 01.05.2028	484	0,18	190 Tenet Healthcare Corp, 5,125 %, fällig 01.11.2027	179	0,07
300 Minerals Technologies Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.07.2028	270	0,10	310 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	298	0,11
930 Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 13,250 %, fällig 15.12.2027	993	0,36	1.630 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	1.546	0,56
670 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	460	0,17	260 TKC Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.05.2028	213	0,08
90 MSCI Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2031	78	0,03	350 TopBuild Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.03.2029	292	0,11
150 Navient Corp, 5,625 %, fällig 01.08.2033	113	0,04	260 TransDigm Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.12.2025	266	0,10
620 NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	583	0,21	1.000 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	988	0,36
290 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	251	0,09	270 TransDigm Inc, 7,500 %, fällig 15.03.2027	267	0,10
550 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.02.2027	511	0,19	310 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	309	0,11
410 NCR Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.04.2029	351	0,13	520 Transocean Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.02.2030	530	0,19
570 NMI Holdings Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2025	568	0,21	570 Triumph Group Inc, 7,750 %, fällig 15.08.2025	546	0,20
610 Northern Oil and Gas Inc, 144A, 8,125 %, fällig 01.03.2028	589	0,21	620 Tutor Perini Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2025	519	0,19
2.790 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ^{see}	–	–	58 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	56	0,02
190 Occidental Petroleum Corp, 7,200 %, fällig 15.03.2029	199	0,07	80 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	75	0,03
220 Occidental Petroleum Corp, 6,625 %, fällig 01.09.2030	226	0,08	1.490 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.322	0,48
110 Occidental Petroleum Corp, 7,500 %, fällig 01.05.2031	118	0,04	280 United Rentals North America Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2027	275	0,10
690 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	694	0,25	270 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.12.2029	270	0,10
120 Olin Corp, 5,000 %, fällig 01.02.2030	109	0,04	930 United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig 15.01.2030	878	0,32
840 Option Care Health Inc, 144A, 4,375 %, fällig 31.10.2029	721	0,26	420 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	360	0,13
390 Pactiv LLC, 8,375 %, fällig 15.04.2027	393	0,14	50 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	42	0,02
1.104 Park-Ohio Industries Inc, 6,625 %, fällig 15.04.2027	843	0,31	460 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2029	395	0,14
390 Paysafe Finance Plc / Paysafe Holdings US Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2029	311	0,11	440 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 15.07.2027	141	0,05
1.580 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	1.419	0,52	970 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	958	0,35
670 Plains All American Pipeline LP, Series B, 8,974 %, Ewige Anleihe *	623	0,23	300 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	245	0,09
680 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	622	0,23	170 Vericast Corp, 144A, 11,000 %, fällig 15.09.2026	183	0,07
880 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 3,375 %, fällig 31.08.2027	762	0,28	200 Vericast Corp, 144A, 12,500 %, fällig 15.12.2027	227	0,08
250 Prime Security Services Borrower LLC / Prime Finance Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2028	232	0,08	822 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	715	0,26
330 QVC Inc, 5,450 %, fällig 15.08.2034	165	0,06	160 Viavi Solutions Inc, 144A, 3,750 %, fällig 01.10.2029	134	0,05
420 Rackspace Technology Global Inc, 144A, 3,500 %, fällig 15.02.2028	256	0,09	190 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	163	0,06
550 Radiology Partners Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.02.2028	330	0,12	880 Viper Energy Partners LP, 144A, 5,375 %, fällig 01.11.2027	838	0,30
900 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	924	0,34	630 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	556	0,20
360 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	323	0,12	1.100 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	1.010	0,37
670 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	708	0,26	450 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, fällig 01.02.2025	427	0,16
830 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.03.2029	668	0,24	990 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	837	0,30
50 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01.03.2031	39	0,01	1.000 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	826	0,30
590 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2038	533	0,19	170 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	202	0,07
370 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 01.06.2025	394	0,14	400 WW International Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.04.2029	204	0,07
120 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31.08.2026	110	0,04	390 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	390	0,14
320 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 11,625 %, fällig 15.08.2027	341	0,12	1.107 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	1.013	0,37
220 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2030	221	0,08	600 XPO Escrow Sub LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.11.2027	609	0,22
780 Sabre Global Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2027	780	0,28	710 Ziff Davis Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2030	600	0,22
1.170 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 5,625 %, fällig 01.12.2025	1.142	0,42	180 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	151	0,06
520 Scientific Games International Inc, 144A, 8,625 %, fällig 01.07.2025	532	0,19	370 ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.02.2029	308	0,11
200 Sealed Air Corp, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2028	197	0,07		117.162	42,60
670 Service Properties Trust, 7,500 %, fällig 15.09.2025	665	0,24	Sambia – 0,83 % (28. Februar 2022: 0,79 %)		
260 Service Properties Trust, 5,500 %, fällig 15.12.2027	235	0,09	207 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	201	0,07
530 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.11.2026	488	0,18	610 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2026	582	0,21
800 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029	653	0,24	1.600 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	1.503	0,55
550 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028	489	0,18		2.286	0,83
1.240 Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	1.299	0,47	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 178.925 \$)		
880 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	757	0,28	162.728		
610 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	613	0,22	59,17		
508 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	510	0,19	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 5,45 % (28. Februar 2022: 14,10 %)		
500 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	596	0,22	Angola – 0,07 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
810 StoneMor Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	586	0,21	210 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032		
830 StoneX Group Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2025	836	0,30	189		
320 Summit Midstream Holdings LLC / Summit Midstream Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.10.2026	304	0,11	Argentinien – 0,68 % (28. Februar 2022: 0,67 %)		
			8 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029		
			47 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,500 %, fällig 09.07.2030		
			500 Ciudad Autonoma De Buenos Aires/Staatsanleihen, 7,500 %, fällig 01.06.2027		
			2.248 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 5,250 %, 5,250 %, fällig 01.09.2037		
			665 Provincia de Cordoba, 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027		
			1.861		

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Bahamas – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,14 %)					
550	531	0,19	249	241	0,09
Internationale Anleihe der Regierung der Bahamas, 144A, 5,750 %, fällig 16.01.2024			Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, fällig 01.10.2027 *		
Brasilien – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,75 %)					
770	591	0,22	208	208	0,08
Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 5,000 %, fällig 27.01.2045			Garda World Security Corp, 8,850 %, fällig 30.10.2026 *		
Cote d'Ivoire (Ivory Coast) – 0,26 % (28. Februar 2022: 0,30 %)					
180	146	0,05	77	62	0,02
Internationale Staatsanleihe Côte d'Ivoire, 144A, 4,875 %, fällig 30.01.2032			Global Medical Response, Inc, 8,830 %, fällig 24.09.2025 *		
660	573	0,21	203	200	0,07
Internationale Staatsanleihe Côte d'Ivoire, 6,125 %, fällig 15.06.2033			Great Outdoors Group LLC, 8,320 %, fällig 05.03.2028 *		
	719	0,26	628	612	0,22
			Greystone Select Financial, 9,798 %, fällig 06.05.2028 *		
Dominikanische Republik – 0,23 % (28. Februar 2022: 0,26 %)					
700	636	0,23	229	224	0,08
Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 6,000 %, fällig 22.02.2033			Hayward Industries Inc., 7,911 %, fällig 28.05.2028 *		
Gabun – 0,07 % (28. Februar 2022: 0,11 %)					
250	204	0,07	196	191	0,07
Internationale Anleihe der Regierung von Gabun, 144A, 7,000 %, fällig 24.11.2031			Hayward Industries Inc., 7,070 %, fällig 14.05.2028 *		
Deutschland – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
280	269	0,10	256	256	0,09
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2026			Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,070 %, fällig 22.04.2028 *		
Indonesien – 1,35 % (28. Februar 2022: 2,51 %)					
750	707	0,26	476	397	0,14
Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 3,500 %, fällig 11.01.2028			One Call Corp, 10,375 %, fällig 07.04.2027 *		
IDR 29,496,000	1.967	0,71	797	682	0,25
Indonesische Schatzanleihe, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027			PECF USS Intermediate Holding Corp, 8,820 %, fällig 04.11.2028 *		
IDR 15,502,000	1.000	0,36	413	410	0,15
Indonesische Schatzanleihe, Series FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031			Peraton Corporation, 8,320 %, fällig 22.02.2028 *		
IDR 721,000	52	0,02	738	722	0,26
Indonesische Schatzanleihe, Series FR68, 8,375 %, fällig 15.03.2034			Polyconcept North America Holdings Inc, 10,080 %, fällig 12.05.2029 *		
	3.726	1,35	499	498	0,18
			Prime Security Installations Ltd, 7,517 %, fällig 23.09.2026 *		
Jordanien – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
560	576	0,21	130	117	0,04
Internationale Anleihe der jordanischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028			Project Sky Merger Sub, Inc., 10,570 %, fällig 10.08.2029 *		
Kasachstan – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,24 %)					
500	518	0,19	249	249	0,09
Internationale Anleihe der kasachischen Regierung, 5,125 %, fällig 21.07.2025			Quikrete Holdings Inc, 0,000 %, fällig 18.03.2029 *		
Mexiko – 0,65 % (28. Februar 2022: 0,87 %)					
13,970	731	0,26	316	260	0,10
Mexikanische Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029			Redstone Holdco 2 LP, 9,568 %, fällig 27.04.2028 *		
1.280	1.065	0,39	510	500	0,18
Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 4,750 %, fällig 08.03.2044			Scotera Health Holdings LLC, 0,000 %, fällig 13.12.2026 *		
	1.796	0,65	370	366	0,13
			Sedgwick Claims Management Services Inc, 0,000 %, fällig 17.02.2028 *		
Panama – 0,25 % (28. Februar 2022: 0,29 %)					
930	683	0,25	550	549	0,20
Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 4,500 %, fällig 01.04.2056			Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 0,000 %, fällig 27.02.2029 *		
Peru – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,29 %)					
690	570	0,21	695	664	0,24
Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 2,783 %, fällig 23.01.2031			Tutor Perini Corp, 9,320 %, fällig 18.08.2027 *		
Katar – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,38 %)					
580	553	0,20	357	240	0,09
Internationale Anleihe der Regierung von Katar, 144A, 4,817 %, fällig 14.03.2049			U.S. Renal Care Inc, 9,625 %, fällig 14.06.2026 *		
USA – 0,57 % (28. Februar 2022: 5,80 %)					
1.570	1.562	0,57	245	244	0,09
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027			United Airlines Inc, 8,568 %, fällig 14.04.2028 *		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 16.849 \$)					
	14.984	5,45	249	249	0,09
Schuldscheindarlehen – 5,09 % (28. Februar 2022: 6,54 %)					
430	287	0,10	56	47	0,02
8Th Avenue Food & Provisions Inc, 12,320 %, fällig 01.10.2026 *†			Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, fällig 04.01.2028 *		
460	461	0,17	260	255	0,09
Accisure LLC, 10,447 %, fällig 15.02.2027 *			Virgin Pulse Inc, 8,570 %, fällig 30.03.2028 *		
113	95	0,04	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 14.906 \$)		
Allen Media LLC, 10,230 %, fällig 10.02.2027 *			14.000		
3	3	–	5,09		
Allied Universal Holdco LLC, 8,411 %, fällig 14.05.2028 *					
52	52	0,02	Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,18 % (28. Februar 2022: 1,55 %)		
67	66	0,02			
API Group Inc, 7,070 %, fällig 01.10.2026 *			EUR 5 Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend		
249	242	0,09	507		
Apollo Group CMR, 7,320 %, fällig 15.05.2026 *			0,18		
249	242	0,09	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 528 \$)		
Ascensus Holdings Inc, 8,250 %, fällig 02.08.2028 *			507		
195	183	0,07	Vorzugsaktien – 0,88 % (28. Februar 2022: 2,23 %)		
Asurion LLC, 8,680 %, fällig 17.08.2028 *					
571	540	0,20	USA: 0,88 % (28. Februar 2022: 2,23 %)		
Asurion LLC, 8,978 %, fällig 19.08.2028 *					
193	184	0,07	67 MPLX LP, Series A ∞		
Asurion LLC, 7,820 %, fällig 18.12.2026 *			2.424		
249	248	0,09	Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2.188 \$)		
Brown Group Holding LLC, 7,047 %, fällig 07.06.2028 *			2.424		
220	220	0,08	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 293.471 \$)		
Caesars Entertainment, 7,817 %, fällig 25.01.2030 *			267.865		
315	156	0,06	97,40		
City Brewing Co LLC, 8,330 %, fällig 31.03.2028 *					
490	488	0,18	Kontrakte (in Tsd.)		
Columbus McKinnon Corp, 0,000 %, fällig 14.05.2028 *					
249	246	0,09	Gekaufte Optionen – 0,20 % (28. Februar 2022: 0,11 %)		
DCert Buyer, Inc., 8,696 %, fällig 16.10.2026 *					
644	550	0,20	– IMM Euro\$ Dezember 2023 Call 99,00, fällig 18.12.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Equinox Holdings Inc, 13,730 %, fällig 08.03.2024 *			– S&P 500 E-mini Juni 2023 Put 3,600,00, fällig 16.06.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
105	88	0,03	– S&P 500 E-mini Juni 2023 Put 3,700,00, fällig 16.06.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Eyecare Partners LLC, 8,480 %, fällig 05.02.2027 *			– S&P 500 E-mini März 2023 Put 3,500,00, fällig 17.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
535	522	0,19	– S&P 500 E-mini März 2023 Put 3,600,00, fällig 17.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
First Brands Group LLC, 10,252 %, fällig 24.03.2027 *			– S&P 500 E-mini W3 Mai 2023 Put 3,700,00, fällig 19.05.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
4	4	–	– S&P 500 E-mini W3 Mai 2023 Put 3,800,00, fällig 19.05.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
Focus Financial Partners LLC, 7,811 %, fällig 30.06.2028 *			5.460 USD Call/JPY Put 133,80, fällig 03.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch		
790	805	0,29	3.570 USD Put/MXN Call 19.6440, fällig 07.03.2023 – Morgan Stanley		
Froneri Lux FinCo SARL, 5,067 %, fällig 30.01.2027 *			Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 544 \$)		
			566		
			Credit Default Swaps – 0,06 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			155		
			Index-Swaps – 0,32 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			878		
			Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2022: 1,44 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			536		
			Futures – 0,02 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			53		
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
			270.053		
			98,20		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Verkaufte Optionen – -0,01 % (28. Februar 2022: -0,05 %)		
– S&P 500 E-mini Juni 2023 Put 3,200,00, fällig 16.06.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-12	–
– S&P 500 E-mini März 2023 Put 3,300,00, fällig 17.03.2023 – Bank of America Merrill Lynch	–	–
– S&P 500 E-mini W3 Mai 2023 Put 3,300,00, fällig 19.05.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-7	–
– S&P 500 E-mini W3 Mai 2023 Put 3,500,00, fällig 19.05.2023 – Bank of America Merrill Lynch	-17	-0,01
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -72 \$)	-36	-0,01
Index-Swaps – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-5	–
Zinsswaps – -0,28 % (28. Februar 2022: -0,15 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-756	-0,28
Devisenterminkontrakte – -1,08 % (28. Februar 2022: -1,95 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.965	-1,08
Futures – -0,32 % (28. Februar 2022: -0,60 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-890	-0,32
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-4.652	-1,69
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	265.401	96,51
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	9.611	3,49
Gesamtneuvermögen	275.012 \$	100,00

ABKÜRZUNGEN:

Ewige Anleihe	–	Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC	–	Real Estate Mortgage Investment Conduit
TBA	–	To be announced
CAD	–	Kanadischer Dollar
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund Sterling
IDR	–	Indonesische Rupiah
MXN	–	Mexikanischer Peso

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	88,00
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	4,86
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,18
Finanzderivate	0,76
Sonstige Vermögenswerte	6,20
Gesamtvermögen	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 2023 belaufen sich diese Wertpapiere auf 164.595.000 \$ und machten 59,80 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.

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

ε Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

± 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 2023.

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2027	5.315	\$ 83
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2027	6.896	72
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 107 \$)				\$ 155
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 107 \$)				\$ 155

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Zinssatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Floating MXN TIIE Banxico, Receive Fixed 7,450 %	18. Juli 2029	170.990	\$ -756
Nicht realisierte Wertsteigerung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -532 \$)				-756
Nettowertminderung von Zinsswaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): -532 \$)				\$ -756

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzinheit	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,510 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	1.733	\$ 248
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,620 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2048	661	82
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 2,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2047	2.951	355
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	903	48
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,250 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Sep. 2029	4.770	145
Bank of America Merrill Lynch	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	30. Juni 2029	3.468	-5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30 \$)				\$ 878
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				-5
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30 \$)				\$ 873

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
8. März 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 1.401	Verkauf MXN 28.155	\$ -135
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 218	Verkauf CAD 294	3
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 101	Verkauf CHF 92	2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.136	Verkauf EUR 1.061	12
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 8	Verkauf GBP 6	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 4.067	Verkauf GBP 3.366	20
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 154.024	Verkauf USD 186.147	-823
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 599	Verkauf USD 718	3
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 4.057	Verkauf USD 4.423	-107
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 24.755	Verkauf USD 18.416	-271
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 47.980	Verkauf USD 51.574	-777
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 1.211	Verkauf MXN 23.640	-68
18. Apr. 2023	Bank of America Merrill Lynch	Kauf EUR 970	Verkauf USD 1.042	-13
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 9.681	Verkauf EUR 8.955	182
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf EUR 940	Verkauf USD 1.010	-12
18. Apr. 2023	Citi	Kauf EUR 600	Verkauf USD 645	-9
18. Apr. 2023	Citi	Kauf JPY 72.694	Verkauf USD 549	-11
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 1.273	Verkauf JPY 165.820	46
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 1.816	Verkauf MXN 35.030	-81
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf MXN 3.976	Verkauf USD 201	14
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY 706.468	Verkauf USD 5.351	-125
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 247	Verkauf AUD 360	4
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 39	Verkauf BRL 200	1
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 3.295	Verkauf CAD 4.390	75
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.628	Verkauf CNH 18.007	28
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 3.325	Verkauf IDR 51.961.824	-79
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 127	Verkauf JPY 16.010	8
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD -	Verkauf NZD -	-
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf BRL 1.987	Verkauf USD 371	5
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CAD 5.763	Verkauf USD 4.315	-89
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf IDR 13.876.120	Verkauf USD 914	-5
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 750	Verkauf AUD 1.060	35
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 6.536	Verkauf GBP 5.353	92
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf MXN 2.489	Verkauf USD 128	6
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf NOK 37.429	Verkauf USD 3.756	-143
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf AUD 9.181	Verkauf USD 6.404	-217
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5.345 \$)				\$ 536
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -7.240 \$)				-2.965
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.895 \$)				\$ -2.429

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Bank of America Merrill Lynch	145	\$ 34.347	\$ -285
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Bank of America Merrill Lynch	46	11.061	-52
3 Month SOFR Index Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	68	16.086	-136
Australia 10 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	20	1.584	-63
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-1	-142	28
ICE 3 Month SONIA Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	3	860	-2
ICE 3 Month SONIA September 2023	Bank of America Merrill Lynch	80	22.908	-59
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	22	2.645	-13
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	198	22.108	-4
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	38	4.453	2
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	158	32.189	-73
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	47	5.032	-9
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-20	-2.505	23
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	183	24.716	-194
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 774 \$)				\$ 53
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.239 \$)				-890
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.465 \$)				\$ -837

[^] 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 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 12,60 % (28. Februar 2022: 19,51 %)					
1.190	1.196	0,21	3.362	3.321	0,59
23	22	–	1.500	1.096	0,20
2.390	80	0,01	2.451	2.121	0,38
696	586	0,11	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 91.959 \$)		
1.244	323	0,06	70.510	12,60	
83	80	0,01	Forderungsbesicherte Wertpapiere – 80,10 % (28. Februar 2022: 73,99 %)		
3.660	2.422	0,43	463	409	0,07
5.526	1.519	0,27	422	383	0,07
818	678	0,12	1.182	1.112	0,20
962	954	0,17	2.177	1.347	0,24
1.888	1.745	0,31	554	342	0,06
1.584	1.306	0,23	567	351	0,06
3.318	2.809	0,50	642	591	0,11
4.869	4.111	0,74	620	384	0,07
4	3	–	789	489	0,09
6.687	2.846	0,51	84	52	0,01
2.335	1.662	0,30	376	233	0,04
2.868	1.961	0,35	4.768	577	0,10
2.970	411	0,07	952	830	0,15
500	468	0,08	6.455	682	0,12
2.650	2.468	0,44	2.990	764	0,14
2.375	2.060	0,37	1.046	1.034	0,18
1.441	921	0,17	3.970	1.353	0,24
2.395	1.499	0,27	6.000	4.849	0,87
1.231	774	0,14	851	403	0,07
31	30	0,01	5.940	5.396	0,96
4.698	4.593	0,82	885	1.107	0,20
78	75	0,01	1.306	1.123	0,20
4	4	–	1.698	1.705	0,30
1.281	783	0,14	3.500	3.450	0,62
3.000	445	0,08	1.750	1.699	0,30
10.796	7.813	1,40	870	805	0,14
5.987	1.694	0,30	937	701	0,13
6.140	1.597	0,29	289	256	0,05
4.252	3.764	0,67	469	385	0,07
874	717	0,13	421	356	0,06
2.536	1.849	0,33	393	288	0,05
2.485	2.208	0,39	549	379	0,07
120	1.710	0,31	214	130	0,02
–	–	–	838	767	0,14
734	651	0,12	9.200	3.033	0,54
3.713	3.135	0,56	774	347	0,06
			3.529	2.125	0,38

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
3.250	COLT 2021-RPL1 Trust, Series 2021 RPL1, Class B1, 144A, 4,768 %, fällig 25.09.2061 *	2.697	0,48	7.373	1,32
1.908	Comm 2014-UBS2 Mortgage Trust, Series 2014 UBS2, Class E, 144A, 4,981 %, fällig 10.03.2047 *	1.611	0,29	449	0,08
5.409	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 8,717 %, fällig 25.07.2039 *	5.553	0,99	4.639	0,83
8.330	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 8,017 %, fällig 25.10.2039 *	8.280	1,48	5.376	0,96
5.760	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 7,584 %, fällig 25.10.2041 *	5.500	0,98	2.551	0,46
86	Credit Suisse First Boston Mortgage Securities Corp, Series 2005 C2, Class AMFX, 4,877 %, fällig 15.04.2037	85	0,02	4.720	0,84
320	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 3,343 %, fällig 25.06.2034 *	242	0,04	3.273	0,59
9.700	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class E, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	5.665	1,01	5.546	0,99
9.200	CSMC 2014-USA OA LLC, Series 2014 USA, Class F, 144A, 4,373 %, fällig 15.09.2037	4.899	0,88	4.000	0,63
4.373	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B1, 144A, 2,954 %, fällig 25.07.2057 *	3.246	0,58	4.926	0,94
5.017	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B2, 144A, 2,954 %, fällig 25.07.2057 *	3.311	0,59	2.508	0,48
4.266	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B3, 144A, 2,954 %, fällig 25.07.2057 *	2.507	0,45	2.546	0,50
4.357	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B4, 144A, 2,954 %, fällig 25.07.2057 *	855	0,15	5.487	1,00
2.223	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B3, 144A, 4,415 %, fällig 01.08.2057 *	2.084	0,37	6.919	1,28
5.998	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B4, 144A, 4,415 %, fällig 01.08.2057 *	5.452	0,97	6.369	1,18
7.859	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Class 11A2, 1,883 %, fällig 25.08.2036 *†	1.206	0,22	5.499	0,99
99	CSMC Resecuritization Trust 2006-1R, Series 2006 1R, Class 1A2, 144A, 6,828 %, fällig 27.07.2036 *	124	0,02	4.587	0,84
4.622	CSMC Series 2015-2R, Series 2015 2R, Class 7A2, 144A, 3,598 %, fällig 27.08.2036 *	3.498	0,63	5.879	1,05
4.282	CSMC Trust 2013-IVR5, Series 2013 IVR5, Class B5, 144A, 3,622 %, fällig 25.10.2043 *	2.858	0,51	5.879	1,05
2.000	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,938 %, fällig 15.07.2032 *	1.860	0,33	6.862	1,23
323.437	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class AX1, 144A, 0,091 %, fällig 25.02.2048 *	815	0,15	27.943	4,93
4.319	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B5, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048 *	3.022	0,54	720	0,11
8.649	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class B6, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048 *	4.211	0,75	3.894	0,69
-	CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	-	-	3.259	0,57
4.000	CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 8,001 %, fällig 15.08.2035 *	3.708	0,66	12.784	2,27
592	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Class 2A2B, 5,431 %, fällig 19.01.2045 *	383	0,07	8.784	1,56
1.414	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR3, Series 2005 AR3, Class 2A1B, 5,071 %, fällig 19.07.2045 *	1.301	0,23	3.411	0,59
2.358	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Class 2A1B, 5,271 %, fällig 19.09.2045 *	1.870	0,33	5.651	1,01
484	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 2A1B, 4,771 %, fällig 19.04.2047 *	498	0,09	7.310	1,30
5.326	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C01, Class 1B, 16,367 %, fällig 25.08.2028 *	6.036	1,08	827	0,14
3.659	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C02, Class 1B, 16,867 %, fällig 25.09.2028 *	4.163	0,74	3.578	0,61
2.937	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C03, Class 1B, 16,367 %, fällig 25.10.2028 *	3.311	0,59	711	0,12
4.873	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C04, Class 1B, 14,867 %, fällig 25.01.2029 *	5.310	0,95	691	0,11
7.165	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Class 1B, 13,867 %, fällig 25.04.2029 *	7.622	1,36	3.427	0,57
4.000	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 1B1, 8,767 %, fällig 25.02.2030 *	4.213	0,75	4.390	0,76
3.210	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C07, Class 1B1, 8,617 %, fällig 25.05.2030 *	3.410	0,61	2.575	0,43
2.060	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 8,367 %, fällig 25.10.2030 *	2.168	0,39	25.982	4,54
7.750	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C06, Class 1B1, 8,367 %, fällig 25.03.2031 *	8.116	1,45	1.250	0,21
1.716	Fannie Mae REMICS, Series 2017 85, Class SC, 1,583 %, fällig 25.11.2047 *	139	0,03	4.907	0,84
3.590	Freddie Mac Multifamily Structured Credit Risk, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 7,834 %, fällig 25.07.2041 *	3.136	0,56	546	0,09
6.605	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K038, Class X3, 2,489 %, fällig 25.06.2042 *	166	0,03	80	0,01
19.370	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K052, Class X3, 1,615 %, fällig 25.01.2044 *	727	0,13	48	0,00
6.000	Freddie Mac Stac Remic Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B2, 144A, 9,867 %, fällig 25.01.2050 *	5.622	1,01	127	0,02
8.088	Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class B2, 144A, 9,417 %, fällig 25.02.2050 *	7.373	1,32	530	0,09
530	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 9,984 %, fällig 25.01.2034 *	449	0,08	5.020	0,87
5.020	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B2, 144A, 11,984 %, fällig 25.10.2041 *	4.639	0,83	4.620	0,81
4.620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Class B2, 144A, 15,367 %, fällig 25.01.2049 *	5.376	0,96	2.250	0,39
2.250	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA2, Series 2019 DNA2, Class B2, 144A, 15,117 %, fällig 25.03.2049 *	2.551	0,46	4.600	0,79
4.600	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B1, 144A, 7,867 %, fällig 25.07.2049 *	4.720	0,84	3.100	0,52
3.100	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B2, 144A, 12,767 %, fällig 25.07.2049 *	3.273	0,59	5.550	0,95
5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B2, 144A, 10,867 %, fällig 25.10.2049 *	5.546	0,99	4.000	0,67
4.000	Freddie Mac Stacr Trust 2019-FTR4, Series 2019 FTR4, Class B2, 144A, 9,617 %, fällig 25.11.2047 *	3.526	0,63	4.926	0,84
4.926	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA1, Class B, 14,617 %, fällig 25.07.2028 *	5.264	0,94	2.508	0,43
2.508	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA2, Class B, 15,117 %, fällig 25.10.2028 *	2.705	0,48	2.546	0,43
2.546	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA3, Class B, 15,867 %, fällig 25.12.2028 *	2.810	0,50	5.487	0,94
5.487	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2016 DNA4, Class B, 13,217 %, fällig 25.03.2029 *	5.621	1,00	6.919	1,21
6.919	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 DNA2, Class B2, 15,867 %, fällig 25.10.2029 *	7.182	1,28	6.369	1,08
6.369	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2017 HRP1, Class B2D, 7,617 %, fällig 25.12.2042 *	4.420	0,79	5.499	0,94
5.499	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI1, Class B, 144A, 3,784 %, fällig 25.02.2048 *	3.089	0,55	5.879	1,01
3.089	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI2, Class B, 144A, 3,834 %, fällig 25.05.2048 *	3.436	0,61	6.862	1,18
3.436	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2018 SPI3, Class B, 144A, 4,161 %, fällig 25.08.2048 *	4.093	0,73	27.943	4,81
4.093	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Class B, 144A, 3,971 %, fällig 25.02.2038 *	23.010	4,11	720	0,11
23.010	Government National Mortgage Association, Series 2010 102, Class IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *	-	-	3.894	0,66
-	Government National Mortgage Association, Series 2010 13, Class IO, 0,000 %, fällig 16.11.2051 *	-	-	3.259	0,54
-	Government National Mortgage Association, Series 2011 127, Class IO, 0,079 %, fällig 16.03.2047 *	5	0,00	12.784	2,13
5	Government National Mortgage Association, Series 2011 95, Class IO, 0,007 %, fällig 16.04.2051 *	2	0,00	8.784	1,46
2	Government National Mortgage Association, Series 2012 114, Class IO, 0,612 %, fällig 16.01.2053 *	135	0,02	3.411	0,56
135	Government National Mortgage Association, Series 2013 163, Class IO, 1,018 %, fällig 16.02.2046 *	54	0,01	5.651	0,94
54	Government National Mortgage Association, Series 2014 16, Class IO, 0,457 %, fällig 16.06.2055 *	81	0,01	7.310	1,21
81	Government National Mortgage Association, Series 2014 171, Class IO, 0,423 %, fällig 16.11.2055 *	74	0,01	827	0,13
74	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,147 %, fällig 16.02.2048 *	5	0,00	3.578	0,58
5	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,629 %, fällig 16.09.2055 *	90	0,02	711	0,11
90	Government National Mortgage Association, Series 2016 135, Class SB, 1,510 %, fällig 16.10.2046 *	94	0,02	691	0,11
94	Government National Mortgage Association, Series 2016 51, Class NS, 1,452 %, fällig 20.04.2046 *	65	0,01	3.427	0,55
65	Government National Mortgage Association, Series 2018 125, Class HS, 1,652 %, fällig 20.09.2048 *	281	0,05	4.390	0,72
281	Government National Mortgage Association, Series 2022 202, Class Z, 3,000 %, fällig 16.10.2063 *	2.719	0,49	2.575	0,41
2.719	Government National Mortgage Association, Series 2023 16, Class Z, 3,500 %, fällig 16.07.2063 *	1.734	0,31	25.982	4,31
1.734	GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5, Series 2018 SRP5, Class D, 144A, 11,088 %, fällig 15.09.2031 *	8.253	1,48	1.250	0,20
8.253	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC26, Series 2014 GC26, Class D, 144A, 4,521 %, fällig 10.11.2047 *	859	0,15	4.907	0,80
859	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Series 2006 1F, Class 6A1, 5,017 %, fällig 25.02.2036 *	546	0,10	80	0,01
546	HarborView Mortgage Loan Trust 2004-11, Series 2004 11, Class 3A3, 5,351 %, fällig 19.01.2035 *	71	0,01	48	0,00
71	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 2A1A, 5,131 %, fällig 19.03.2035 *	46	0,01	127	0,02
46	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-10, Series 2005 10, Class 2A1A, 5,211 %, fällig 19.11.2035 *	98	0,02		

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	
	USD	% vom Nettoinventarwert		USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
420 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 2A1A, 5,031 %, fällig 19.05.2035 *	385	0,07	5.308 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	4.354	0,78
202 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 2A1A, 5,071 %, fällig 19.06.2035 *	191	0,03	4.870 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	3.764	0,67
2.143 HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 4,293 %, fällig 19.09.2035 *	1.874	0,34	3.000 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Series 2022 JERI, Class G, 144A, 12,020 %, fällig 15.01.2039 *	2.718	0,49
479 HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1A, 4,771 %, fällig 19.11.2036 *	425	0,08	3.694 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Series 2016 4A, Class B5, 144A, 4,786 %, fällig 25.11.2056 *	3.268	0,58
876 Impac CMB Trust Series 2005-1, Series 2005 1, Class M1, 5,307 %, fällig 25.04.2035 *	806	0,14	3.000 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class B2, 144A, 4,051 %, fällig 27.11.2056 *	1.963	0,35
1.649 Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class A2, 5,217 %, fällig 25.08.2035 *	1.483	0,27	3.632 Nomura Resecuritization Trust 2015-4R, Series 2015 4R, Class 4A7, 144A, 3,662 %, fällig 26.03.2037 *	3.495	0,62
698 Impac CMB Trust Series 2005-4, Series 2005 4, Class 1M1, 5,047 %, fällig 25.05.2035 *	645	0,12	452 Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class M1, 5,172 %, fällig 25.04.2036 *	328	0,06
1.112 Impac CMB Trust Series 2005-7, Series 2005 7, Class A1, 5,137 %, fällig 25.11.2035 *	972	0,17	3.690 PMT Credit Risk Transfer Trust 2021-1R, Series 2021 1R, Class A, 144A, 7,417 %, fällig 27.02.2024 *	3.639	0,65
1.268 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2B, 6,267 %, fällig 25.08.2036 *	1.219	0,22	3.161 PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,217 %, fällig 29.04.2024 *	3.102	0,55
197 Impac Secured Assets Trust 2006-2, Series 2006 2, Class 2M3, 6,267 %, fällig 25.08.2036 *	197	0,04	3.455 PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 6,867 %, fällig 27.02.2025 *	3.368	0,60
628 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Class 1A1, 3,324 %, fällig 25.08.2035 *	308	0,06	637 RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Class 1A1, 4,867 %, fällig 25.02.2036 *	398	0,07
667 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Class 2A1B, 5,397 %, fällig 25.02.2035 *	473	0,08	8.188 RBSGC Mortgage Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class 3A1, 4,967 %, fällig 25.01.2037 *	2.106	0,38
1.808 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 5,277 %, fällig 25.04.2035 *	1.401	0,25	12.948 Redwood Funding Trust 2019-1, Series 2019 1, Class PT, 144A, 4,468 %, fällig 27.09.2024	12.467	2,23
2.395 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 8,608 %, fällig 15.10.2032 *	2.392	0,43	1.126 Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Series 2006 R2, Class AF1, 144A, 5,037 %, fällig 25.07.2036 *	1.020	0,18
2.250 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class F, 144A, 9,908 %, fällig 15.10.2032 *	2.218	0,40	3.588 Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Series 2006 A7CB, Class 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036	2.797	0,50
28.545 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-PHMZ, Series 2018 PHMZ, Class M, 144A, 13,096 %, fällig 15.06.2035 *†	-	-	12.974 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25.06.2057 †	2.134	0,38
4.022 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Class D, 144A, 8,338 %, fällig 15.05.2028 *	3.724	0,67	19.879 Seasoned Credit Risk Transfer Trust 2017-4, Series 2017 4, Class BIO, 144A, 1,706 %, fällig 25.06.2057 *†	2.981	0,53
1.800 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144A, 8,230 %, fällig 05.07.2033 *	1.304	0,23	4.409 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25.09.2055 †	664	0,12
6.574 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class G, 144A, 9,088 %, fällig 15.12.2036 *	2.331	0,42	8.004 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class BIO, 144A, 0,923 %, fällig 25.09.2055 *†	940	0,17
6.867 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-MKST, Series 2020 MKST, Class H, 144A, 11,588 %, fällig 15.12.2036 *	1.739	0,31	3.571 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	3.172	0,57
322 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2020-NNN MZ, Series 2020 NNNZ, Class M, 144A, 8,542 %, fällig 16.01.2037	279	0,05	51.785 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.09.2055 *†	226	0,04
4.000 JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2021-NYMZ, Series 2021 NYMZ, Class M, 144A, 11,838 %, fällig 15.06.2026 *	3.873	0,69	12.939 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class B, 144A, 0,000 %, fällig 25.08.2056 †	2.085	0,37
3.814 JP Morgan Mortgage Trust 2007-S3, Series 2007 S3, Class 1A18, 5,117 %, fällig 25.08.2037 *	1.367	0,24	21.448 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class BIO, 144A, 1,090 %, fällig 25.08.2056 *†	2.333	0,42
9.842 JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class AX1, 144A, 0,213 %, fällig 25.10.2048 *†	45	0,01	420.987 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-2, Series 2017 2, Class XSIO, 144A, 0,075 %, fällig 25.08.2056 *†	1.723	0,31
10.830 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class AX1, 144A, 0,229 %, fällig 25.10.2048 *†	67	0,01	3.250 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2017-3, Series 2017 3, Class M2, 144A, 4,750 %, fällig 25.07.2056 *	2.894	0,52
1.952 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B5, 144A, 3,729 %, fällig 25.10.2048 *	1.244	0,22	2.728 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	2.451	0,44
2.632 JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Series 2018 5, Class B6, 144A, 3,729 %, fällig 25.10.2048 *	1.442	0,26	11.460 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 3,189 %, fällig 25.11.2057 *	3.811	0,68
5.420 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C25, Series 2014 C25, Class D, 144A, 3,935 %, fällig 15.11.2047 *	3.420	0,61	16.071 Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class BX, 144A, 1,660 %, fällig 25.08.2057 *	5.575	1,00
12 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-15, Series 2004 15, Class 6A1, 4,947 %, fällig 25.12.2034 *	11	-	2.630 STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B1, 144A, 8,517 %, fällig 25.09.2048 *	2.717	0,49
1.830 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Class B1, 3,853 %, fällig 25.07.2034 *	1.670	0,30	3.000 STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B2, 144A, 12,367 %, fällig 25.09.2048 *	3.147	0,56
1.225 MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Class B1, 3,698 %, fällig 25.09.2034 *	1.059	0,19	650 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class D, 144A, 8,088 %, fällig 15.11.2027 *	26	-
720 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 1A1, 144A, 6,000 %, fällig 25.08.2034	488	0,09	14.332 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class E, 144A, 8,988 %, fällig 15.11.2027 *†	29	0,01
853 MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 1A1F, 144A, 4,967 %, fällig 25.05.2035 *	454	0,08	323 Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2, Class 1A1, 4,154 %, fällig 25.03.2034 *	298	0,05
378 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJ, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	97	0,02	3.570 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR5, Series 2006 AR5, Class 4A1, 5,057 %, fällig 25.05.2046 *	1.218	0,22
187 ML-CFC Commercial Mortgage Trust 2007-5, Series 2007 5, Class AJFL, 144A, 5,450 %, fällig 12.08.2048 *	48	0,01	54 Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 1A1, 4,977 %, fällig 25.07.2046 *	45	0,01
5.000 Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Class D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	3.449	0,62	3.900 Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B2, 144A, 3,480 %, fällig 25.03.2058 *	3.090	0,55
1.634 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1, 5,217 %, fällig 25.01.2035 *	1.275	0,23	7.118 Towd Point Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class B2, 144A, 3,267 %, fällig 25.06.2058 *	4.597	0,82
3.372 Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Series 2006 8AR, Class 1A3, 4,937 %, fällig 25.06.2036 *	777	0,14	4.000 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH, Series 2018 NYCH, Class F, 144A, 8,409 %, fällig 15.02.2032 *	3.828	0,68
521 Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 2,401 %, fällig 25.04.2046 *	521	0,09	3.374 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Class B1, 5,532 %, fällig 25.08.2045 *	2.799	0,50
			1.038 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9, Class B1, 5,562 %, fällig 25.07.2045 *	798	0,14
			1.343 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class B, 144A, 6,461 %, fällig 14.09.2022 *	1.127	0,20

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			
1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Class D, 144A, 3,906 %, fällig 15.09.2057 *	993		0,18
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 589.494 \$)	448.236		80,10
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,48 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
USA – 0,48 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
3.000 Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, fällig 15.01.2026	2.686		0,48
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.608 \$)	2.686		0,48
Schuldscheindarlehen – 3,29 % (28. Februar 2022: 2,76 %)			
30.000 American Dream, – %, fällig 29.06.2024 *†∞	2.926		0,52
1.613 Freehand Hotel, 8,330 %, fällig 17.12.2024 *∞	1.607		0,29
2.935 Freehand Hotel, 8,330 %, fällig 17.12.2024 *∞	2.924		0,52
5.452 Freehand Hotel, 8,330 %, fällig 17.12.2024 *∞	5.432		0,97
5.551 Sono Retail Loan, 7,947 %, fällig 06.06.2023 *∞	5.518		0,99
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 45.452 \$)	18.407		3,29
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,08 % (28. Februar 2022: 3,43 %)			
17.212 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	17.212		3,08
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 17.212 \$)	17.212		3,08
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 746.725 \$)	557.051		99,55
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	8		–
Futures – 0,05 % (28. Februar 2022: 0,05 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	317		0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	557.376		99,60
Devisenterminkontrakte – -0,30 % (28. Februar 2022: -0,33 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.683		-0,30
Futures – -0,01 % (28. Februar 2022: -0,20 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-73		-0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.756		-0,31
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	555.620		99,29
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	3.928		0,71
Gesamtnettovermögen	559.548 \$		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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 350.611.000 \$ und machten 62,65 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- † Nicht liquide.
- ∞ Die Bewertung von Wertpapieren erfolgt in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach Ermessen des Bewertungsausschusses.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,82
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	3,28
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,06
Finanzderivate	0,06
Sonstige Vermögenswerte	0,78
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	8
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf JPY	Verkauf USD	-1.573
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	-102
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF	Verkauf USD	-8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 203 \$)				8
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -3.513 \$)				-1.683
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -3.310 \$)				-1.675

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-84	\$ -9.844
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-415	-84.547
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	62	6.638
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-109	-13.649
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	34	4.592
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 502 \$)			317
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.083 \$)			-73
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.581 \$)			244

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			2.261 Fannie Mae REMICS, Series 2019 45, Class BS, 1,433 %, fällig 25.08.2049 *	235	0,02
2.846 Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, fällig 01.06.2038	2.635	0,24	4.010 Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	782	0,07
170 Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500 %, fällig 01.11.2051	145	0,01	1.181 Fannie Mae REMICS, Series 2019 57, Class NS, 1,383 %, fällig 25.10.2049 *	121	0,01
16.797 Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, fällig 01.11.2051	13.860	1,24	1.501 Fannie Mae REMICS, Series 2019 58, Class HS, 1,383 %, fällig 25.10.2049 *	135	0,01
5.686 Fannie Mae Pool 'FM9456', 3,500 %, fällig 01.11.2051	5.261	0,47	3.135 Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 1,383 %, fällig 25.10.2049 *	320	0,03
6.703 Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, fällig 01.03.2037	6.206	0,55	1.263 Fannie Mae REMICS, Series 2020 26, Class SA, 1,333 %, fällig 25.05.2050 *	124	0,01
15.831 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01.07.2051	12.957	1,16	949 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	567	0,05
8.311 Fannie Mae Pool 'FM9733', 2,500 %, fällig 01.10.2051	7.091	0,63	1.708 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class BI, 2,000 %, fällig 25.09.2050	215	0,02
339 Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500 %, fällig 01.12.2051	290	0,03	2.503 Fannie Mae REMICS, Series 2020 67, Class IH, 2,000 %, fällig 25.09.2050	317	0,03
1.093 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, fällig 01.09.2051	937	0,08	155 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	26	-
238 Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, fällig 01.11.2050	213	0,02	13.693 Fannie Mae REMICS, Series 2020 88, Class GI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	2.054	0,18
4.250 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	3.757	0,34	1.086 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	159	0,01
3.603 Fannie Mae Pool 'FS0352', 2,000 %, fällig 01.01.2052	2.945	0,26	9.010 Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.367	0,12
360 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, fällig 01.01.2052	323	0,03	6.393 Fannie Mae REMICS, Series 2020 93, Class LI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	924	0,08
2.672 Fannie Mae Pool 'FS0424', 3,000 %, fällig 01.01.2052	2.288	0,20	25.860 Fannie Mae REMICS, Series 2021 42, Class NI, 2,500 %, fällig 25.11.2048	3.345	0,30
265 Fannie Mae Pool 'FS0464', 2,000 %, fällig 01.01.2052	217	0,02	7.980 Fannie Mae REMICS, Series 2021 46, Class BI, 2,500 %, fällig 25.12.2048	1.030	0,09
2.382 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01.02.2052	2.121	0,19	5.359 Fannie Mae REMICS, Series 2021 49, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	728	0,07
2.808 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.401	0,21	1.208 Fannie Mae REMICS, Series 2021 54, Class KI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	174	0,02
463 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 01.07.2051	397	0,04	9.672 Fannie Mae REMICS, Series 2021 59, Class TI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	1.418	0,13
2.418 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.072	0,19	1.546 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class KI, 2,500 %, fällig 25.04.2049	220	0,02
1.694 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.450	0,13	5.914 Fannie Mae REMICS, Series 2021 85, Class IN, 2,500 %, fällig 25.02.2050	891	0,08
1.477 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.217	0,11	13.612 Fannie Mae REMICS, Series 2021 91, Class IG, 2,500 %, fällig 25.01.2052	2.034	0,18
6.531 Fannie Mae Pool 'FS0605', 2,500 %, fällig 01.02.2052	5.567	0,50	11.428 Fannie Mae REMICS, Series 2022 29, Class KZ, 1,500 %, fällig 25.06.2042	7.907	0,71
855 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 01.02.2052	706	0,06	320 Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Class AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	286	0,03
6.174 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 01.12.2051	5.293	0,47	15.609 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,187 %, fällig 25.06.2029 *	760	0,07
554 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 01.03.2052	496	0,04	14.946 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M13, Class X1, 0,825 %, fällig 25.06.2034 *	666	0,06
354 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, fällig 01.01.2045	321	0,03	37.527 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Class X1, 0,560 %, fällig 25.06.2029 *	1.039	0,09
453 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, fällig 01.11.2048	411	0,04	5.456 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Class IO, 1,747 %, fällig 25.01.2029 *	434	0,04
822 Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, fällig 01.11.2050	704	0,06	34.077 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Class X1, 0,464 %, fällig 25.04.2032 *	979	0,09
188 Fannie Mae Pool 'FS1624', 2,500 %, fällig 01.10.2051	160	0,01	5.197 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Class X1, 1,699 %, fällig 25.01.2037 *	522	0,05
1.326 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 01.04.2052	1.146	0,10	15.556 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31, Class X2, 1,237 %, fällig 25.12.2032 *	971	0,09
278 Fannie Mae Pool 'FS1924', 2,500 %, fällig 01.03.2051	236	0,02	39 Freddie Mac Gold Pool 'A29586', 5,000 %, fällig 01.01.2035	39	-
756 Fannie Mae Pool 'FS1938', 2,500 %, fällig 01.02.2052	645	0,06	9 Freddie Mac Gold Pool 'A30703', 5,500 %, fällig 01.12.2034	10	-
7.169 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	6.640	0,59	100 Freddie Mac Gold Pool 'A35950', 5,000 %, fällig 01.07.2035	101	0,01
8.124 Fannie Mae Pool 'FS3065', 3,000 %, fällig 01.01.2052	7.160	0,64	13 Freddie Mac Gold Pool 'A36526', 5,000 %, fällig 01.08.2035	13	-
5.744 Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500 %, fällig 01.10.2052	5.749	0,51	42 Freddie Mac Gold Pool 'A39036', 5,000 %, fällig 01.05.2035	42	-
1.836 Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, fällig 01.01.2053	1.872	0,17	7 Freddie Mac Gold Pool 'A39302', 5,500 %, fällig 01.11.2035	7	-
10 Fannie Mae Pool 'MA0440', 5,500 %, fällig 01.05.2040	10	-	- Freddie Mac Gold Pool 'A84166', 6,500 %, fällig 01.01.2039	-	-
26 Fannie Mae Pool 'MA0619', 5,500 %, fällig 01.11.2040	27	-	1 Freddie Mac Gold Pool 'C00556', 8,000 %, fällig 01.10.2027	1	-
5 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	5	-	- Freddie Mac Gold Pool 'C01025', 8,000 %, fällig 01.07.2030	-	-
12 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	11	-	- Freddie Mac Gold Pool 'C01051', 8,000 %, fällig 01.09.2030	-	-
16 Fannie Mae Pool 'MA0766', 5,500 %, fällig 01.05.2041	16	-	1 Freddie Mac Gold Pool 'C46047', 8,000 %, fällig 01.12.2030	1	-
6 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	6	-	3 Freddie Mac Gold Pool 'C55319', 8,000 %, fällig 01.08.2031	3	-
155 Fannie Mae Pool 'MA0823', 5,500 %, fällig 01.07.2041	159	0,01	- Freddie Mac Gold Pool 'C57324', 8,000 %, fällig 01.09.2031	-	-
65 Fannie Mae Pool 'MA0867', 5,500 %, fällig 01.09.2041	66	0,01	2 Freddie Mac Gold Pool 'C91046', 6,500 %, fällig 01.05.2027	2	-
141 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	139	0,01			
160 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	157	0,01			
31 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 01.12.2031	31	-			
189 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 01.09.2042	176	0,02			
11 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 01.09.2042	10	-			
45 Fannie Mae Pool 'MA1363', 3,000 %, fällig 01.02.2043	40	-			
1.444 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 01.03.2043	1.388	0,12			
311 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	306	0,03			
244 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01.10.2043	240	0,02			
153 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01.11.2043	151	0,01			
214 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01.12.2043	211	0,02			
436 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01.07.2036	398	0,04			
422 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01.12.2036	385	0,03			
679 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, fällig 01.12.2040	580	0,05			
5.634 Fannie Mae Pool 'MA4208', 2,000 %, fällig 01.12.2050	4.615	0,41			
7.980 Fannie Mae Pool 'MA4325', 2,000 %, fällig 01.05.2051	6.528	0,58			
439 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, fällig 01.07.2041	375	0,03			
625 Fannie Mae Pool 'MA4428', 4,000 %, fällig 01.08.2051	589	0,05			
2.903 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig 01.03.2042	2.453	0,22			
966 Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	170	0,02			
960 Fannie Mae REMICS, Series 2012 124, Class SD, 1,533 %, fällig 25.11.2042 *	99	0,01			
1.384 Fannie Mae REMICS, Series 2012 22, Class SM, 1,883 %, fällig 25.03.2042 *	143	0,01			
629 Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,467 %, fällig 25.07.2036 *	761	0,07			
790 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	836	0,07			
3.760 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	3.820	0,34			
6.182 Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	897	0,08			
2.054 Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Class PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	1.702	0,15			
3.734 Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Class IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	709	0,06			
974 Fannie Mae REMICS, Series 2019 25, Class PI, 5,000 %, fällig 25.05.2048	192	0,02			
4.163 Fannie Mae REMICS, Series 2019 38, Class SH, 1,544 %, fällig 25.07.2049 *	379	0,03			
2.087 Fannie Mae REMICS, Series 2019 44, Class SM, 1,433 %, fällig 25.08.2049 *	261	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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
1.080	988	0,09	9.960	904	0,08
Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig 01.02.2038			Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K110, Class X1, 1,697 %, fällig 25.04.2030 *		
– Freddie Mac Gold Pool 'G00556', 8,000 %, fällig 01.09.2026	–	–	3.989 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K115, Class X1, 1,326 %, fällig 25.06.2030 *	300	0,03
1 Freddie Mac Gold Pool 'G00726', 8,000 %, fällig 01.06.2027	1	–	7.963 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, Class X1, 1,425 %, fällig 25.07.2030 *	629	0,06
– Freddie Mac Gold Pool 'G00931', 8,000 %, fällig 01.11.2026	–	–	989 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, Class X1, 1,024 %, fällig 25.10.2030 *	58	0,01
5 Freddie Mac Gold Pool 'G02427', 5,500 %, fällig 01.12.2036	5	–	76.519 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Class X1, 0,773 %, fällig 25.12.2030 *	3.514	0,31
27 Freddie Mac Gold Pool 'G04581', 6,500 %, fällig 01.08.2038	28	–	2.992 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Class X1, 0,720 %, fällig 25.12.2030 *	131	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'G04947', 6,500 %, fällig 01.04.2038	1	–	12.497 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Class X1, 0,508 %, fällig 25.08.2031 *	432	0,04
4 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	4	–	58.280 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Class X1, 0,305 %, fällig 25.02.2032 *	1.363	0,12
103 Freddie Mac Gold Pool 'G07335', 7,000 %, fällig 01.03.2039	110	0,01	61.479 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Class X1, 0,297 %, fällig 25.03.2032 *	1.394	0,12
231 Freddie Mac Gold Pool 'G07509', 6,500 %, fällig 01.09.2039	241	0,02	85.346 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Class X1, 0,342 %, fällig 25.04.2035 *	2.256	0,20
944 Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, fällig 01.03.2046	931	0,08	17.895 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Class X1, 0,250 %, fällig 25.07.2032 *	393	0,04
170 Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, fällig 01.03.2033	161	0,01	28.481 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Class X1, 0,532 %, fällig 25.10.2031 *	1.003	0,09
1.293 Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, fällig 01.06.2040	1.331	0,12	4.179 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 1515, Class X1, 1,511 %, fällig 25.02.2035 *	490	0,04
3.698 Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, fällig 01.12.2045	3.585	0,32	5.632 Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,269 %, fällig 01.01.2049 *	5.324	0,48
5.098 Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, fällig 01.09.2048	4.737	0,42	2.597 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,007 %, fällig 01.11.2048 *	2.450	0,22
9.024 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	8.171	0,73	509 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 2,877 %, fällig 01.11.2047 *	488	0,04
1 Freddie Mac Gold Pool 'H00790', 5,500 %, fällig 01.05.2037	1	–	900 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,096 %, fällig 01.02.2050 *	860	0,08
44 Freddie Mac Gold Pool 'H02425', 5,500 %, fällig 01.02.2038	44	–	92 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	83	0,01
1 Freddie Mac Gold Pool 'H09170', 5,500 %, fällig 01.01.2038	1	–	335 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 01.02.2050	309	0,03
291 Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, fällig 01.10.2033	273	0,02	3.153 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig 01.02.2050	2.805	0,25
176 Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, fällig 01.12.2033	165	0,01	122 Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, fällig 01.05.2050	110	0,01
172 Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, fällig 01.06.2044	169	0,02	201 Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, fällig 01.05.2050	181	0,02
1.536 Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, fällig 01.05.2045	1.474	0,13	478 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01.11.2050	412	0,04
63 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	60	0,01	312 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01.11.2050	268	0,02
381 Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, fällig 01.11.2042	367	0,03	78 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 01.02.2051	65	0,01
312 Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, fällig 01.11.2042	301	0,03	149 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	124	0,01
33 Freddie Mac Gold Pool 'U90598', 3,500 %, fällig 01.12.2042	31	–	72 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 01.02.2051	60	0,01
80 Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, fällig 01.12.2042	75	0,01	78 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig 01.03.2051	64	0,01
48 Freddie Mac Gold Pool 'U90768', 3,500 %, fällig 01.01.2043	45	–	230 Freddie Mac Pool 'QB9484', 2,000 %, fällig 01.03.2051	191	0,02
64 Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, fällig 01.01.2043	60	0,01	161 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig 01.03.2051	134	0,01
97 Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, fällig 01.01.2043	90	0,01	87 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig 01.03.2051	72	0,01
145 Freddie Mac Gold Pool 'U90828', 3,500 %, fällig 01.02.2043	136	0,01	74 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig 01.03.2051	61	0,01
159 Freddie Mac Gold Pool 'U90879', 3,500 %, fällig 01.02.2043	148	0,01	82 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig 01.03.2051	67	0,01
115 Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, fällig 01.02.2043	107	0,01	86 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig 01.04.2051	72	0,01
129 Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, fällig 01.02.2043	120	0,01	78 Freddie Mac Pool 'QC1164', 2,000 %, fällig 01.04.2051	65	0,01
3.854 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	3.594	0,32	168 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 01.05.2051	147	0,01
2.012 Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, fällig 01.02.2044	1.936	0,17	579 Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, fällig 01.06.2051	517	0,05
57.629 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Class X1, 0,667 %, fällig 25.04.2027 *	1.322	0,12	449 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01.07.2051	386	0,03
83.189 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Class X1, 0,348 %, fällig 25.09.2027 *	1.170	0,10	874 Freddie Mac Pool 'QC4446', 2,500 %, fällig 01.07.2051	747	0,07
54.532 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Class XAM, 0,081 %, fällig 25.06.2028 *	340	0,03	435 Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, fällig 01.08.2051	374	0,03
57.720 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Class XAM, 0,073 %, fällig 25.08.2028 *	345	0,03	457 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig 01.08.2051	392	0,04
884 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, Class X1, 0,561 %, fällig 25.03.2029 *	25	–	360 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig 01.08.2051	308	0,03
4.988 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, Class X1, 1,523 %, fällig 25.01.2030 *	409	0,04	541 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01.08.2051	465	0,04
			4.002 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	3.438	0,31
			1.904 Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, fällig 01.09.2051	1.633	0,15
			3.835 Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, fällig 01.10.2051	3.283	0,29
			1.009 Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, fällig 01.11.2051	863	0,08
			4.258 Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, fällig 01.12.2051	3.517	0,31
			94 Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, fällig 01.11.2051	83	0,01
			91 Freddie Mac Pool 'QD2260', 3,000 %, fällig 01.12.2051	80	0,01
			7.402 Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, fällig 01.12.2051	6.602	0,59
			262 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig 01.01.2052	225	0,02
			554 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig 01.02.2052	454	0,04
			672 Freddie Mac Pool 'QD5628', 2,000 %, fällig 01.02.2052	550	0,05
			94 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig 01.02.2052	77	0,01
			852 Freddie Mac Pool 'QD5960', 2,000 %, fällig 01.02.2052	698	0,06
			552 Freddie Mac Pool 'QD5961', 2,000 %, fällig 01.02.2052	452	0,04
			3.451 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.960	0,26
			284 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig 01.02.2052	243	0,02
			195 Freddie Mac Pool 'QD6216', 3,000 %, fällig 01.02.2052	173	0,02
			276 Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, fällig 01.02.2052	227	0,02
			655 Freddie Mac Pool 'QE1492', 3,500 %, fällig 01.05.2052	604	0,05
			197 Freddie Mac Pool 'QE5811', 4,000 %, fällig 01.07.2052	185	0,02
			3.123 Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500 %, fällig 01.08.2052	3.137	0,28
			2.981 Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500 %, fällig 01.08.2052	2.992	0,27
			898 Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000 %, fällig 01.12.2052	915	0,08
			200 Freddie Mac Pool 'QF6516', 6,500 %, fällig 01.01.2053	205	0,02
			200 Freddie Mac Pool 'QF6690', 6,500 %, fällig 01.01.2053	205	0,02
			200 Freddie Mac Pool 'QF8222', 6,500 %, fällig 01.02.2053	206	0,02
			300 Freddie Mac Pool 'QF8298', 6,500 %, fällig 01.03.2053	309	0,03
			1.222 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01.09.2049	1.099	0,10

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
2.222	Freddie Mac Pool 'RA2114', 3,500 %, fällig 01.02.2050	2.046	0,18		
7.063	Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, fällig 01.02.2050	6.340	0,57	1.314	Freddie Mac REMICS 4808, Class SB, 1,612 %, fällig 15.07.2048 *
382	Freddie Mac Pool 'RA2729', 2,500 %, fällig 01.06.2050	328	0,03	155	189 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048
407	Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig 01.11.2050	337	0,03	164	1.624 Freddie Mac REMICS 4856, Class IO, 5,000 %, fällig 15.01.2049
5.830	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	5.029	0,45	304	853 Freddie Mac REMICS 4870, Class ES, 1,412 %, fällig 15.04.2049 *
18.807	Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig 01.12.2050	16.223	1,45	86	1.745 Freddie Mac REMICS 4882, Class S, 1,462 %, fällig 15.05.2049 *
1.839	Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig 01.12.2050	1.574	0,14	233	2.432 Freddie Mac REMICS 4921, Class SN, 1,433 %, fällig 25.10.2049 *
69	Freddie Mac Pool 'RA4349', 2,500 %, fällig 01.01.2051	59	0,01	1.085	Freddie Mac REMICS 4936, Class YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049
459	Freddie Mac Pool 'RA4414', 2,500 %, fällig 01.01.2051	393	0,04	1.394	Freddie Mac REMICS 4962, Class SP, 1,433 %, fällig 25.03.2050 *
2.293	Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000 %, fällig 01.02.2051	2.043	0,18	4.746	Freddie Mac REMICS 4988, Class AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050
75	Freddie Mac Pool 'RA4532', 2,500 %, fällig 01.02.2051	65	0,01	2.326	Freddie Mac REMICS 4995, Class IQ, 2,500 %, fällig 25.07.2050
576	Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 01.02.2051	474	0,04	10.079	Freddie Mac REMICS 4995, Class QL, 2,500 %, fällig 25.07.2050
1.535	Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 01.05.2051	1.261	0,11	5.039	Freddie Mac REMICS 5000, Class IB, 2,500 %, fällig 25.07.2050
176	Freddie Mac Pool 'RA5373', 2,000 %, fällig 01.06.2051	145	0,01	4.003	Freddie Mac REMICS 5000, Class UI, 2,500 %, fällig 25.07.2050
1.573	Freddie Mac Pool 'RA5576', 2,500 %, fällig 01.07.2051	1.344	0,12	1.688	Freddie Mac REMICS 5027, Class HI, 2,000 %, fällig 25.10.2050
1.211	Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig 01.09.2051	1.027	0,09	148	Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050
8.629	Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01.09.2041	7.321	0,65	2.381	Freddie Mac REMICS 5058, Class IL, 2,500 %, fällig 25.01.2051
2.290	Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	1.833	0,16	697	Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051
292	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	236	0,02	5.163	Freddie Mac REMICS 5070, Class NI, 2,000 %, fällig 25.02.2051
11.304	Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, fällig 01.09.2041	9.929	0,89	9.156	Freddie Mac REMICS 5078, Class EI, 1,500 %, fällig 25.01.2051
156	Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 01.07.2047	150	0,01	21.173	Freddie Mac REMICS 5085, Class IK, 2,500 %, fällig 25.03.2051
244	Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, fällig 01.07.2045	236	0,02	11.558	Freddie Mac REMICS 5092, Class IU, 2,500 %, fällig 25.02.2051
151	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	125	0,01	3.695	Freddie Mac REMICS 5113, Class NI, 2,500 %, fällig 25.06.2051
346	Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig 01.02.2051	308	0,03	11.937	Freddie Mac REMICS 5134, Class KI, 2,500 %, fällig 25.07.2048
5.062	Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, fällig 01.02.2050	4.851	0,43	11.149	Freddie Mac REMICS 5135, Class DI, 2,500 %, fällig 25.05.2048
343	Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig 01.07.2051	293	0,03	1.468	Freddie Mac REMICS 5149, Class NI, 2,500 %, fällig 25.01.2051
2.611	Freddie Mac Pool 'SD0731', 2,000 %, fällig 01.05.2051	2.139	0,19	9.666	Freddie Mac REMICS 5160, Class IU, 2,500 %, fällig 25.11.2050
7.246	Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig 01.11.2051	6.184	0,55	9.941	Freddie Mac REMICS 5162, Class DI, 2,500 %, fällig 25.11.2051
3.843	Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01.01.2052	3.388	0,30	7.700	Freddie Mac REMICS 5169, Class PW, 2,000 %, fällig 25.09.2051
924	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	792	0,07	7.200	Freddie Mac REMICS 5178, Class CY, 2,000 %, fällig 25.01.2042
385	Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, fällig 01.04.2052	343	0,03	4.900	Freddie Mac REMICS 5209, Class EQ, 3,000 %, fällig 25.04.2052
3.106	Freddie Mac Pool 'SD0957', 3,500 %, fällig 01.04.2052	2.832	0,25	1.204	Freddie Mac Strips 312, Class S1, 1,362 %, fällig 15.09.2043 *
7.032	Freddie Mac Pool 'SD1070', 3,500 %, fällig 01.04.2052	6.485	0,58	4.000	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 6,784 %, fällig 25.08.2033 *
3.083	Freddie Mac Pool 'SD1071', 3,500 %, fällig 01.04.2052	2.834	0,25	–	Ginnie Mae I Pool '410304', 7,500 %, fällig 15.12.2025
16.560	Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig 01.09.2050	16.196	1,45	1	Ginnie Mae I Pool '417463', 7,000 %, fällig 15.09.2025
14.443	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	13.809	1,23	–	Ginnie Mae I Pool '430208', 7,000 %, fällig 15.09.2027
3.924	Freddie Mac Pool 'SD1586', 3,500 %, fällig 01.08.2052	3.620	0,32	–	Ginnie Mae I Pool '462669', 7,000 %, fällig 15.04.2028
4.691	Freddie Mac Pool 'SD1876', 5,500 %, fällig 01.11.2052	4.719	0,42	–	Ginnie Mae I Pool '486470', 6,500 %, fällig 15.08.2028
7.319	Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig 01.12.2052	7.462	0,67	–	Ginnie Mae I Pool '486516', 6,500 %, fällig 15.09.2028
636	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	568	0,05	–	Ginnie Mae I Pool '519569', 8,000 %, fällig 15.05.2030
221	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	191	0,02	24	Ginnie Mae I Pool '646044', 6,500 %, fällig 15.10.2037
705	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	610	0,05	1	Ginnie Mae I Pool '652203', 5,000 %, fällig 15.03.2036
24.053	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	20.679	1,85	3	Ginnie Mae I Pool '658182', 6,000 %, fällig 15.11.2036
5.865	Freddie Mac Pool 'SD8135', 2,500 %, fällig 01.03.2051	4.994	0,45	1	Ginnie Mae I Pool '675375', 5,000 %, fällig 15.05.2038
4.897	Freddie Mac Pool 'SD8146', 2,000 %, fällig 01.05.2051	4.005	0,36	1	Ginnie Mae I Pool '676940', 5,000 %, fällig 15.04.2038
1.210	Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, fällig 01.05.2034	1.157	0,10	4	Ginnie Mae I Pool '683926', 5,000 %, fällig 15.02.2038
1.630	Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, fällig 01.06.2036	1.488	0,13	6	Ginnie Mae I Pool '684334', 5,000 %, fällig 15.02.2038
267	Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, fällig 01.03.2048	255	0,02	2	Ginnie Mae I Pool '684754', 5,000 %, fällig 15.04.2038
240	Freddie Mac Pool 'Z19993', 5,000 %, fällig 01.05.2040	242	0,02	2	Ginnie Mae I Pool '684848', 5,000 %, fällig 15.04.2038
2.125	Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, fällig 01.07.2046	1.979	0,18	2	Ginnie Mae I Pool '686062', 5,000 %, fällig 15.05.2038
383	Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, fällig 01.10.2042	357	0,03	52	Ginnie Mae I Pool '698086', 6,000 %, fällig 15.04.2039
812	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	758	0,07	10	Ginnie Mae I Pool '701501', 5,000 %, fällig 15.12.2038
2.278	Freddie Mac Pool 'ZN0608', 3,500 %, fällig 01.02.2043	2.124	0,19	277	Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, fällig 15.06.2039
90	Freddie Mac Pool 'ZN0614', 3,500 %, fällig 01.02.2043	83	0,01	119	Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040
107	Freddie Mac Pool 'ZN0628', 3,500 %, fällig 01.02.2043	100	0,01	262	Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040
58	Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, fällig 01.12.2048	57	0,01	1	Ginnie Mae I Pool '780732', 7,000 %, fällig 15.03.2028
11	Freddie Mac Pool 'ZS0823', 5,000 %, fällig 01.12.2034	11	–	–	
321	Freddie Mac Pool 'ZS1355', 6,000 %, fällig 01.03.2037	333	0,03	–	
6	Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, fällig 01.07.2037	6	–	–	
9	Freddie Mac Pool 'ZS1821', 5,500 %, fällig 01.11.2037	9	–	–	
137	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	141	0,01	–	
10.287	Freddie Mac Pool 'ZS4751', 3,500 %, fällig 01.01.2048	9.490	0,85	–	
156	Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01.10.2032	147	0,01	–	
232	Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, fällig 01.10.2046	209	0,02	–	
39	Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, fällig 01.08.2048	39	–	–	
2.249	Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, fällig 01.01.2043	2.039	0,18	–	
783	Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig 01.03.2043	730	0,07	–	
140	Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig 01.02.2044	130	0,01	–	
146	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	131	0,01	–	
36	Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, fällig 01.03.2049	35	–	–	
154	Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01.04.2033	148	0,01	–	
1.835	Freddie Mac Pool 'ZT2228', 3,500 %, fällig 01.06.2049	1.691	0,15	–	
4.600	Freddie Mac REMICS 3810, Class WA, 5,442 %, fällig 15.06.2040 *	4.657	0,42	–	
3.057	Freddie Mac REMICS 3998, Class DS, 1,912 %, fällig 15.02.2042 *	337	0,03	–	
2.170	Freddie Mac REMICS 4134, Class IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	355	0,03	–	
825	Freddie Mac REMICS 4280, Class AI, 3,000 %, fällig 15.02.2028	19	–	–	
4.800	Freddie Mac REMICS 4377, Class UZ, 3,000 %, fällig 15.08.2044	3.869	0,35	–	
285	Freddie Mac REMICS 4403, Class IG, 3,500 %, fällig 15.07.2032	10	–	–	
1.220	Freddie Mac REMICS 4715, Class JS, 1,562 %, fällig 15.08.2047 *	137	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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert			USD	Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)							
500	360		0,03	3.388	2.907		0,26
13.504	312		0,03	3.515	2.611		0,23
5.437	786		0,07	2.120	1.956		0,17
1.884	271		0,02	7.922	49		–
4.004	570		0,05	1.157	1.076		0,10
488	71		0,01	1.553	1.275		0,11
167	24		–	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.212.429 \$)			
5.489	936		0,08	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,42 % (28. Februar 2022: 12,73 %)			
243	34		–	USA – 2,42 % (28. Februar 2022: 12,73 %)			
742	102		0,01	8.300	8.226		0,74
4.466	484		0,04	6.800	6.727		0,60
4.121	710		0,06	8.300	8.146		0,73
4.730	568		0,05	60	56		0,01
538	89		0,01	4.320	3.852		0,34
1.424	235		0,02	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.470 \$)			
1.011	157		0,01	Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,10 % (28. Februar 2022: 1,63 %)			
864	130		0,01	1.154	1.154		0,10
5.906	187		0,02	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.154 \$)			
1.339	1.332		0,12	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.260.454 \$)			
149	145		0,01	Futures – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,14 %)			
1.105	1.071		0,10	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 353 0,03			
28.691	1.966		0,18	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
1.099	872		0,08	Futures – -0,06 % (28. Februar 2022: -0,06 %)			
6.692	993		0,09	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -731 -0,06			
14.143	1.928		0,17	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
3.605	259		0,02	Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten			
16.369	2.797		0,25	Gesamnettovermögen			
2.825	2.248		0,20	1.147.959 102,55			
7.700	1.381		0,12	-28.452 -2,55			
50.058	3.018		0,27	Gesamnettovermögen			
6.528	982		0,09	1.119.507 \$ 100,00			
21.639	1.621		0,14	– 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 %.			
29.295	1.826		0,16	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 37.628.000 \$ und machten 3,36 % des Nettovermögens aus.			
5.340	893		0,08	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.			
5.400	3.726		0,33	† Nicht liquide.			
1.100	1.027		0,09	± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.			
9.200	7.194		0,64	ABKÜRZUNGEN:			
9.468	7.263		0,65	REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit			
4.411	222		0,02	TBA – To be announced			
3.157	1.737		0,16	Verteilung des Gesamtvermögens			
39.388	1.979		0,18	Gesamtvermögens			
1.900	1.617		0,14	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 95,23			
1.300	770		0,07	Organismen für gemeinsame Anlagen 0,10			
6.119	4.907		0,44	Finanzderivate 0,03			
				Sonstige Vermögenswerte 4,64			
				Gesamtvermögen			
				100,00			

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-153	\$ -17.084	\$ 20
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	12	1.406	1
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-540	-110.012	328
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	1.221	130.714	-498
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	489	61.232	-233
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-4	-540	4
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.640 \$)				\$ 353
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -666 \$)				-731
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 974 \$)				\$ -378

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 94,04 % (28. Februar 2022: 89,45 %)			Supranational – 3,11 % (28. Februar 2022: 3,00 %)		
Australien – 0,98 % (28. Februar 2022: 1,61 %)			810 European Investment Bank, 1,375 %, fällig 07.03.2025 762 1,66		
160 APA Infrastructure Ltd, 3,125 %, fällig 18.07.2031	130	0,29	680 European Investment Bank, 3,750 %, fällig 07.12.2027	665	1,45
380 National Australia Bank Ltd, 1,699 %, fällig 15.09.2031 *	318	0,69		1.427	3,11
	448	0,98	Schweden – 2,10 % (28. Februar 2022: 1,41 %)		
Belgien – 0,56 % (28. Februar 2022: 1,02 %)			340 Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, fällig 23.08.2032 *		
166 Anheuser-Busch InBev SA/NV, 4,000 %, fällig 24.09.2025	163	0,36	350 Swedbank AB, 1,375 %, fällig 08.12.2027 *	303	0,66
USD 110 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,800 %, fällig 23.01.2059	95	0,20	410 Vattenfall AB, 2,500 %, fällig 29.06.2083 *	342	0,74
	258	0,56		965	2,10
Kanada – 1,29 % (28. Februar 2022: 0,72 %)			Schweiz – 2,89 % (28. Februar 2022: 3,74 %)		
340 Royal Bank of Canada, 1,375 %, fällig 09.12.2024	319	0,69	EUR 350 Credit Suisse Group AG, 2,250 %, fällig 09.06.2028 *	276	0,60
300 Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027	275	0,60	130 Credit Suisse Group AG, 7,750 %, fällig 01.03.2029 *	114	0,25
	594	1,29	380 Credit Suisse Group AG, 2,125 %, fällig 15.11.2029 *	280	0,61
Dänemark – 1,57 % (28. Februar 2022: 1,16 %)			650 UBS Group AG, 1,875 %, fällig 03.11.2029 *	539	1,17
220 Danske Bank AVS, 4,625 %, fällig 13.04.2027 *	216	0,47	130 Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, fällig 23.11.2052 *	119	0,26
350 Danske Bank AVS, 2,250 %, fällig 14.01.2028 *	304	0,66		1.328	2,89
250 Orsted AS, 2,500 %, fällig 16.05.2033	200	0,44	Vereinigtes Königreich – 42,05 % (28. Februar 2022: 42,35 %)		
	720	1,57	160 Anglian Water Osprey Financing Plc, 2,000 %, fällig 31.07.2028	128	0,28
Finnland – 0,71 % (28. Februar 2022: 1,04 %)			220 Anglian Water Services Financing Plc, 1,625 %, fällig 10.08.2025	205	0,45
400 Nordea Bank Abp, 1,625 %, fällig 09.12.2032 *	326	0,71	210 Annington Funding Plc, 2,308 %, fällig 06.10.2032	153	0,33
Frankreich – 5,69 % (28. Februar 2022: 5,91 %)			520 Annington Funding Plc, 4,750 %, fällig 09.08.2033	461	1,00
290 BNP Paribas SA, 3,375 %, fällig 23.01.2026	275	0,60	360 Aspire Defence Finance Plc, Series A, 4,674 %, fällig 31.03.2040	344	0,75
300 BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	256	0,56	230 Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16.06.2034	184	0,40
300 BNP Paribas SA, 2,000 %, fällig 24.05.2031 *	260	0,57	280 Assura Financing Plc, 3,000 %, fällig 19.07.2028	248	0,54
100 BNP Paribas SA, 5,750 %, fällig 13.06.2032	101	0,22	270 Assura Financing Plc, 1,625 %, fällig 30.06.2033	187	0,41
500 BPCE SA, 2,500 %, fällig 30.11.2032 *	412	0,90	117 Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	107	0,23
400 Credit Agricole SA, 4,875 %, fällig 23.10.2029	392	0,85	190 Aviva Plc, 6,875 %, fällig 20.05.2058 *	199	0,43
220 Credit Agricole SA, 7,500 %, Ewige Anleihe *	219	0,48	EUR 360 Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	314	0,68
300 Electricite de France SA, 1,000 %, fällig 29.11.2033	187	0,41	260 Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 *	235	0,51
100 Electricite de France SA, 5,500 %, fällig 27.03.2037	94	0,20	493 Barclays Plc, 3,250 %, fällig 12.02.2027	450	0,98
100 Electricite de France SA, 5,500 %, fällig 17.10.2041	92	0,20	200 BP Capital Markets Plc, 2,274 %, fällig 03.07.2026	186	0,41
100 Electricite de France SA, 6,000 %, fällig 23.01.2114	93	0,20	570 British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	457	0,99
300 TotalEnergies Capital International SA, 1,405 %, fällig 03.09.2031	230	0,50	240 British Telecommunications Plc, 3,125 %, fällig 21.11.2031	201	0,44
	2.611	5,69	130 Burberry Group Plc, 1,125 %, fällig 21.09.2025	118	0,26
Deutschland – 5,43 % (28. Februar 2022: 5,74 %)			250 Cadent Finance Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2038	171	0,37
200 Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026 *	190	0,41	100 Chancellor Masters & Scholars of The University of Cambridge/The, 2,350 %, fällig 27.06.2078	58	0,13
190 Deutsche Telekom AG, 3,125 %, fällig 06.02.2034	160	0,35	300 Clarion Funding Plc, 1,250 %, fällig 13.11.2032	212	0,46
400 E.ON International Finance BV, 6,125 %, fällig 06.07.2039	415	0,90	200 Clarion Funding Plc, 1,875 %, fällig 22.01.2035	139	0,30
940 Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, fällig 07.12.2028	1.022	2,23	150 Clarion Funding Plc, 3,125 %, fällig 19.04.2048	102	0,22
200 Volkswagen Financial Services NV, 2,125 %, fällig 27.06.2024	192	0,42	320 Close Brothers Group Plc, 2,000 %, fällig 11.09.2031 *	270	0,59
400 Volkswagen International Finance NV, 3,375 %, fällig 16.11.2026	371	0,81	300 Coventry Building Society, 2,000 %, fällig 20.12.2030	232	0,51
EUR 200 Vonovia SE, 2,375 %, fällig 25.03.2032	144	0,31	235 Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029	220	0,48
	2.494	5,43	540 Derwent London Plc, 1,875 %, fällig 17.11.2031	389	0,85
Italien – 1,73 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			92 Eastern Power Networks Plc, 6,250 %, fällig 12.11.2036	102	0,22
341 Enel Finance International NV, 5,750 %, fällig 14.09.2040	336	0,73	220 Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29.10.2025	198	0,43
210 Intesa Sanpaolo SpA, 2,625 %, fällig 11.03.2036	143	0,31	170 Experian Finance Plc, 3,250 %, fällig 07.04.2032	149	0,33
USD 400 UniCredit SpA, 7,296 %, fällig 02.04.2034 *	314	0,69	220 Folio Residential Finance NO 1 Plc, 1,246 %, fällig 31.10.2027	184	0,40
	793	1,73	278 Gatwick Funding Ltd, 6,125 %, fällig 02.03.2026	285	0,62
Luxemburg – 1,21 % (28. Februar 2022: 0,80 %)			100 Gatwick Funding Ltd, 2,500 %, fällig 15.04.2030	83	0,18
240 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 2,625 %, fällig 20.10.2028	187	0,40	100 Gatwick Funding Ltd, 3,250 %, fällig 26.02.2048	67	0,14
190 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4,875 %, fällig 29.04.2032	155	0,34	190 GlaxoSmithKline Capital Plc, 6,375 %, fällig 09.03.2039	216	0,47
260 Prologis International Funding II SA, 2,750 %, fällig 22.02.2032	215	0,47	100 Grainger Plc, 3,375 %, fällig 24.04.2028	86	0,19
	557	1,21	190 Grainger Plc, 3,000 %, fällig 03.07.2030	150	0,33
Niederlande – 1,95 % (28. Februar 2022: 1,86 %)			154 Greene King Finance Plc, Series A2, 5,318 %, fällig 15.09.2031	144	0,31
400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 23.05.2029	371	0,81	110 Greene King Finance Plc, Series B1, 5,512 %, fällig 15.12.2034 *	85	0,19
300 ING Groep NV, 3,000 %, fällig 18.02.2026	282	0,61	210 Guinness Partnership Ltd/The, 2,000 %, fällig 22.04.2055	108	0,23
240 Koninklijke KPN NV, 5,750 %, fällig 17.09.2029	242	0,53	127 HSBC Holdings Plc, 6,000 %, fällig 29.03.2040	117	0,25
	895	1,95	210 HSBC Holdings Plc, 5,875 %, Ewige Anleihe *	196	0,43
Norwegen – 1,49 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			50 Hutchison Whampoa Finance UK Plc, Series B, 5,625 %, fällig 24.11.2026	51	0,11
240 DNB Bank ASA, 2,625 %, fällig 10.06.2026 *	227	0,49	210 Land Securities Capital Markets Plc, 2,399 %, fällig 08.02.2029	183	0,40
480 DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027 *	458	1,00	100 Land Securities Capital Markets Plc, 2,625 %, fällig 22.09.2037	74	0,16
	685	1,49	520 Leeds Building Society, 1,375 %, fällig 06.10.2027	438	0,95
Südafrika – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,37 %)			190 Leeds Building Society, 3,750 %, fällig 25.04.2029 *	168	0,37
170 Anglo American Capital Plc, 3,375 %, fällig 11.03.2029	151	0,33	120 Legal & General Group Plc, 3,750 %, fällig 26.11.2049 *	101	0,22
Spanien – 2,08 % (28. Februar 2022: 1,34 %)			190 Legal & General Group Plc, 4,500 %, fällig 01.11.2050 *	166	0,36
800 Banco Santander SA, 2,250 %, fällig 04.10.2032 *	655	1,43	230 Liberty Living Finance Plc, 3,375 %, fällig 28.11.2029	196	0,43
100 CaixaBank SA, 6,875 %, fällig 25.10.2033 *	99	0,21	120 LiveWest Treasury Plc, 2,250 %, fällig 10.10.2043	77	0,17
200 Telefonica Emisiones SA, 5,445 %, fällig 08.10.2029	200	0,44	510 Lloyds Bank Plc, 7,625 %, fällig 22.04.2025	536	1,17
	954	2,08	230 Lloyds Banking Group Plc, 6,625 %, fällig 02.06.2033 *	229	0,50
			340 Lloyds Banking Group Plc, 5,125 %, Ewige Anleihe *	320	0,70
			350 Logica 2019-1 UK Plc, 1,875 %, fällig 17.11.2026	308	0,67
			180 London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	146	0,32

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) £	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich – (Fortsetzung)					
177 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,125 %, fällig 02.04.2024	175	0,38	210 GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, fällig 29.03.2038	168	0,37
240 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,750 %, fällig 31.03.2034	228	0,50	USD 310 JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033 *	247	0,54
160 Manchester Airport Group Funding Plc, 2,875 %, fällig 30.09.2044	105	0,23	100 McDonald's Corp, 2,950 %, fällig 15.03.2034	83	0,18
185 Marston's Issuer Plc, Series A3, 5,177 %, fällig 15.07.2032 *	165	0,36	180 McDonald's Corp, Series gmn, 3,750 %, fällig 31.05.2038	152	0,33
108 Marston's Issuer Plc, Series B1, 6,482 %, fällig 16.07.2035 *	85	0,18	92 MetLife Inc, 5,375 %, fällig 09.12.2024	92	0,20
88 Mitchells & Butlers Finance Plc, Series B2, 6,013 %, fällig 15.12.2028	82	0,18	230 Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, fällig 10.01.2030	230	0,50
360 Motability Operations Group Plc, Series EMTN, 4,875 %, fällig 17.01.2043	350	0,76	120 Mondelez International Inc, 4,500 %, fällig 03.12.2035	109	0,24
150 National Express Group Plc, 2,375 %, fällig 20.11.2028	126	0,28	USD 320 Morgan Stanley, 4,210 %, fällig 20.04.2028 *	253	0,55
310 National Gas Transmission Plc, 1,375 %, fällig 07.02.2031	230	0,50	250 Morgan Stanley, 5,789 %, fällig 18.11.2033 *	252	0,55
275 National Grid Electricity Distribution East Midlands Plc, 6,250 %, fällig 10.12.2040	295	0,64	280 Netfix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029	235	0,51
250 National Grid Electricity Transmission Plc, 2,000 %, fällig 17.04.2040	155	0,34	290 New York Life Global Funding, 4,350 %, fällig 16.09.2025	286	0,62
100 Nationwide Building Society, 3,000 %, fällig 06.05.2026	95	0,21	290 Omnicom Capital Holdings Plc, 2,250 %, fällig 22.11.2033	218	0,48
150 Nationwide Building Society, 6,178 %, fällig 07.12.2027 *	153	0,33	210 PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029	193	0,42
206 Nationwide Building Society, 3,250 %, fällig 20.01.2028	190	0,41	100 PepsiCo Inc, 3,550 %, fällig 22.07.2034	89	0,19
230 NatWest Group Plc, 3,125 %, fällig 28.03.2027 *	213	0,46	190 Realty Income Corp, 1,875 %, fällig 14.01.2027	168	0,37
150 NatWest Group Plc, 3,619 %, fällig 29.03.2029 *	135	0,29	265 Time Warner Cable LLC, 5,750 %, fällig 02.06.2031	254	0,55
190 NatWest Group Plc, 2,105 %, fällig 28.11.2031 *	161	0,35	200 Toyota Motor Credit Corp, 0,750 %, fällig 19.11.2026	173	0,38
190 NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	197	0,43	590 Verizon Communications Inc, 1,875 %, fällig 19.09.2030	471	1,03
110 Northern Powergrid Northeast Plc, 3,250 %, fällig 01.04.2052	79	0,17	110 Verizon Communications Inc, 2,500 %, fällig 08.04.2031	91	0,20
120 Notting Hill Genesis, 2,875 %, fällig 31.01.2029	106	0,23	26 Walmart Inc, 5,250 %, fällig 28.09.2035	28	0,06
140 Onward Homes Ltd, 2,125 %, fällig 25.03.2053	76	0,16	410 Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	376	0,82
240 Paragon Treasury Plc, 2,000 %, fällig 07.05.2036	167	0,36	650 Wells Fargo & Co, 4,875 %, fällig 29.11.2035	599	1,30
170 Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig 27.06.2032	164	0,36		8.663	18,87
190 Sanctuary Capital Plc, 2,375 %, fällig 14.04.2050	112	0,24	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 50,295 £)		
440 Santander UK Group Holdings Plc, 2,920 %, fällig 08.05.2026 *	412	0,90	43.175	94,04	
170 Santander UK Plc, 5,750 %, fällig 02.03.2026	175	0,38	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,62 % (28. Februar 2022: 5,81 %)		
198 Scottish Widows Ltd, 7,000 %, fällig 16.06.2043	202	0,44	Vereinigtes Königreich – 0,87 % (28. Februar 2022: 4,38 %)		
350 Segro Plc, 2,875 %, fällig 11.10.2037	264	0,58	160 United Kingdom Gilt, 0,125 %, fällig 31.01.2028	135	0,29
140 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,625 %, fällig 22.02.2033	113	0,25	620 United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22.10.2050	267	0,58
120 Severn Trent Utilities Finance Plc, 4,625 %, fällig 30.11.2034	114	0,25		402	0,87
180 Severn Trent Utilities Finance Plc, 2,000 %, fällig 02.06.2040	114	0,25	USA – 0,75 % (28. Februar 2022: 1,01 %)		
252 South Eastern Power Networks Plc, 5,500 %, fällig 05.06.2026	256	0,56	USD 30 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2041	18	0,04
191 Southern Gas Networks Plc, 2,500 %, fällig 03.02.2025	182	0,40	USD 200 United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.08.2042	150	0,33
380 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	361	0,79	USD 230 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	137	0,30
170 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, fällig 27.02.2035	165	0,36	USD 70 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	39	0,08
201 Tesco Property Finance 3 Plc, 5,744 %, fällig 13.04.2040	196	0,43		344	0,75
328 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	307	0,67	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 833 £)		
190 UNITE Group Plc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2028	167	0,36	746	1,62	
250 UNITE USAF II Plc, 3,921 %, fällig 30.06.2025	240	0,52	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 51.128 £)		
170 University of Oxford, 2,544 %, fällig 08.12.2117	91	0,20	43.921	95,66	
210 Vodafone Group Plc, 5,125 %, fällig 02.12.2052	185	0,40	Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
160 Wellcome Trust Ltd/The, 2,517 %, fällig 07.02.2118	87	0,19	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
470 Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	405	0,88	27	0,06	
180 Yorkshire Building Society, 3,500 %, fällig 21.04.2026	172	0,38	Futures – 0,10 % (28. Februar 2022: 0,08 %)		
140 Yorkshire Building Society, 3,511 %, fällig 11.10.2030 *	121	0,26	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	19.306	42,05	45	0,10	
USA – 18,87 % (28. Februar 2022: 16,06 %)					
USD 100 Apache Corp, 4,750 %, fällig 15.04.2043	64	0,14	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
220 AT&T Inc, Series GBP, 2,900 %, fällig 04.12.2026	204	0,44	-36	-0,09	
190 AT&T Inc, 4,375 %, fällig 14.09.2029	179	0,39	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
200 AT&T Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2040	221	0,48	43.993	95,82	
383 AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2043	306	0,67	Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2022: -0,05 %)		
USD 450 Bank of America Corp, 4,948 %, fällig 22.07.2028 *	366	0,80	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
360 Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031 *	321	0,70	-7	-0,02	
180 Becton Dickinson and Co, 3,020 %, fällig 24.05.2025	172	0,37	Futures – -0,07 % (28. Februar 2022: -0,01 %)		
260 Berkshire Hathaway Finance Corp, 2,625 %, fällig 19.06.2059	163	0,35	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
329 Citigroup Inc, 7,375 %, fällig 01.09.2039	415	0,90	-29	-0,07	
170 Comcast Corp, 1,500 %, fällig 20.02.2029	141	0,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
USD 60 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	41	0,09	-36	-0,09	
240 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 5,875 %, fällig 18.01.2033	246	0,54	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
400 General Motors Financial Co Inc, 2,350 %, fällig 03.09.2025	372	0,81	43.957	95,73	
309 Goldman Sachs Group Inc/The, 7,125 %, fällig 07.08.2025	323	0,70	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,125 %, fällig 25.07.2029	244	0,53	1.955	4,27	
110 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,875 %, fällig 18.01.2038	118	0,26	Gesamtneuvermögen		
			45.912 £	100,00	
– Beträge, die mit „-“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 GBP, weniger als 1.000 GBP, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.					
ABKÜRZUNGEN:					
Ewige Anleihe – Eine Anleihe ohne Fälligkeitsdatum Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern gleichbleibend Zinsen.					
EUR – Euro					
USD – US-Dollar					
Verteilung des Gesamtvermögens					
% des Gesamtvermögens					
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					
Finanzderivate					
Sonstige Vermögenswerte					
Gesamtvermögen					
95,00					
0,16					
4,84					
100,00					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
16. Mai 2023	Citi	Kauf	GBP	106	Verkauf	EUR	118	£	2
16. Mai 2023	Citi	Kauf	USD	34	Verkauf	GBP	28		-
16. Mai 2023	Citi	Kauf	GBP	155	Verkauf	JPY	24.415		4
16. Mai 2023	Citi	Kauf	GBP	33	Verkauf	USD	40		-
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf	GBP	1.622	Verkauf	USD	1.961		-5
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	215	Verkauf	USD	260		-1
16. Mai 2023	UBS	Kauf	GBP	1.069	Verkauf	EUR	1.188		21
16. Mai 2023	UBS	Kauf	USD	139	Verkauf	GBP	115		-
16. Mai 2023	UBS	Kauf	GBP	309	Verkauf	USD	373		-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 8 £)								£	27
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -35 £)									-7
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -27 £)								£	20

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bund März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-2	£ -234	£ 15
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Bank of America Merrill Lynch	-2	-1.791	19
Long Gilt Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	25	2.499	-12
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-26	-2.413	5
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	44	3.916	-14
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	9	937	-3
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-6	-674	6
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 59 £)				£ 45
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -10 £)				-29
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 49 £)				£ 16

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,19 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			Deutschland – 0,89 % (28. Februar 2022: 0,04 %)		
199 SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	183	0,19	30 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	36	0,04
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 204 \$)	183	0,19	840 ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig 29.04.2025	803	0,85
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 96,16 % (28. Februar 2022: 81,87 %)			Indien – 0,28 % (28. Februar 2022: 0,31 %)		
Australien – 0,59 % (28. Februar 2022: 1,08 %)			Irland – 1,18 % (28. Februar 2022: 1,00 %)		
110 BHP Billiton Finance USA Ltd, 4,900 %, fällig 28.02.2033	110	0,12	330 Reliance Industries Ltd, 144A, 2,875 %, fällig 12.01.2032	268	0,28
100 CSL Finance Plc, 144A, 4,050 %, fällig 27.04.2029	93	0,10	Israel – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
90 CSL Finance Plc, 144A, 4,250 %, fällig 27.04.2032	84	0,09	160 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	140	0,15
40 Westpac Banking Corp, 5,405 %, fällig 10.08.2033 *	38	0,04	Italien – 1,76 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
40 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	31	0,03	830 Enel Finance International NV, 144A, 6,800 %, fällig 14.10.2025	851	0,90
130 Westpac Banking Corp, 3,020 %, fällig 18.11.2036 *	100	0,10	210 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,017 %, fällig 26.06.2024	203	0,21
150 Westpac Banking Corp, 3,133 %, fällig 18.11.2041	103	0,11	400 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,000 %, fällig 21.11.2025	409	0,41
Belgien – 0,22 % (28. Februar 2022: 0,36 %)			150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033	117	0,12
240 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,600 %, fällig 15.04.2048	212	0,22	180 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041	132	0,14
Bermudas – 0,49 % (28. Februar 2022: 0,15 %)			60 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2023	60	0,06
500 Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.10.2025	461	0,49	Japan – 1,86 % (28. Februar 2022: 1,19 %)		
Brasilien – 0,16 % (28. Februar 2022: 0,57 %)			210 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, fällig 19.04.2028 *	200	0,21
190 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	150	0,16	340 Nippon Life Insurance Co, 144A, 2,750 %, fällig 21.01.2051 *	279	0,30
Kanada – 2,80 % (28. Februar 2022: 1,86 %)			550 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,043 %, fällig 15.09.2023	541	0,57
67 Air Canada 2015-2 Class B Pass Through Trust, 144A, 5,000 %, fällig 15.12.2023	66	0,07	430 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025	402	0,42
170 Bank of Nova Scotia/The, 3,450 %, fällig 11.04.2025	163	0,17	200 NTT Finance Corp, 144A, 1,162 %, fällig 03.04.2026	177	0,19
40 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	35	0,04	200 NTT Finance Corp, 144A, 2,065 %, fällig 03.04.2031	162	0,17
200 Bank of Nova Scotia/The, 8,625 %, fällig 27.10.2082 *	211	0,22	Kasachstan – 0,16 % (28. Februar 2022 0,10 %)		
140 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	140	0,15	200 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	150	0,16
210 Canadian Pacific Railway Co, 2,450 %, fällig 02.12.2031	175	0,19	Luxemburg – 0,15 % (28. Februar 2022: 0,03 %)		
60 Canadian Pacific Railway Co, 3,000 %, fällig 02.12.2041	46	0,05	110 ArcelorMittal SA, 6,550 %, fällig 29.11.2027	113	0,12
70 Canadian Pacific Railway Co, 3,100 %, fällig 02.12.2051	48	0,05	30 ArcelorMittal SA, 7,000 %, fällig 15.10.2039	30	0,03
550 CI Financial Corp, 3,200 %, fällig 17.12.2030	417	0,44	Macau – 2,59 % (28. Februar 2022: 1,07 %)		
110 Element Fleet Management Corp, 144A, 1,600 %, fällig 06.04.2024	105	0,11	580 Sands China Ltd, 5,625 %, fällig 08.08.2025	563	0,59
70 GFL Environmental Inc, 144A, 5,125 %, fällig 15.12.2026	67	0,07	200 Sands China Ltd, 4,300 %, fällig 08.01.2026	185	0,20
60 MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	61	0,06	400 Sands China Ltd, 5,900 %, fällig 08.08.2028	379	0,40
510 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 14.07.2026	448	0,47	270 Sands China Ltd, 3,350 %, fällig 08.03.2029	221	0,23
30 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030	27	0,03	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030	174	0,19
200 Teck Resources Ltd, 6,250 %, fällig 15.07.2041	201	0,21	200 Sands China Ltd, 4,875 %, fällig 18.06.2030	175	0,18
10 Teck Resources Ltd, 5,400 %, fällig 01.02.2043	9	0,01	600 Wynn Macau Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 01.10.2024	574	0,61
20 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	18	0,02	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2026	183	0,19
240 Yamana Gold Inc, 4,625 %, fällig 15.12.2027	226	0,24	Mexiko – 0,62 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
240 Yamana Gold Inc, 2,630 %, fällig 15.08.2031	185	0,20	200 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 8,375 %, Ewige Anleihe *	197	0,21
	2.648	2,80	200 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,348 %, fällig 09.02.2031	159	0,17
China – 0,77 % (28. Februar 2022: 0,44 %)			220 Fresnillo Plc, 144A, 4,250 %, fällig 02.10.2050	170	0,18
200 Alibaba Group Holding Ltd, 2,125 %, fällig 09.02.2031	160	0,17	60 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	56	0,06
240 Alibaba Group Holding Ltd, 3,150 %, fällig 09.02.2051	154	0,16	Niederlande – 1,13 % (28. Februar 2022: 0,56 %)		
240 BOC Aviation USA Corp, 144A, 1,625 %, fällig 29.04.2024	229	0,24	550 Cooperatieve Rabobank UA, 4,375 %, fällig 04.08.2025	533	0,56
260 Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22.04.2051	188	0,20	440 Cooperatieve Rabobank UA, 144A, 3,758 %, fällig 06.04.2033 *	383	0,40
	731	0,77	120 Shell International Finance BV, 4,375 %, fällig 11.05.2045	106	0,11
Dänemark – 1,82 % (28. Februar 2022: 0,34 %)			70 Shell International Finance BV, 3,250 %, fällig 06.04.2050	52	0,06
200 Danske Bank A/S, 144A, 3,244 %, fällig 20.12.2025 *	190	0,20	Norwegen – 0,50 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
680 Danske Bank A/S, 144A, 6,466 %, fällig 09.01.2026 *	685	0,72	490 DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, fällig 28.03.2025 *	475	0,50
200 Danske Bank A/S, 144A, 1,549 %, fällig 10.09.2027 *	174	0,18	Katar – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,44 %)		
720 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	679	0,72	210 QatarEnergy, 144A, 2,250 %, fällig 12.07.2031	173	0,18
	1.728	1,82			
Frankreich – 4,69 % (28. Februar 2022: 2,59 %)					
200 BNP Paribas SA, 144A, 2,219 %, fällig 09.06.2026 *	185	0,20			
320 BNP Paribas SA, 144A, 1,323 %, fällig 13.01.2027 *	283	0,30			
370 BNP Paribas SA, 144A, 1,675 %, fällig 30.06.2027 *	325	0,34			
460 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	453	0,48			
340 BNP Paribas SA, 144A, 2,159 %, fällig 15.09.2029 *	281	0,30			
200 BNP Paribas SA, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	214	0,23			
520 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	531	0,56			
200 BPCE SA, 144A, 5,700 %, fällig 22.10.2023	199	0,21			
370 BPCE SA, 144A, 3,116 %, fällig 19.10.2032 *	286	0,30			
300 Credit Agricole SA, 144A, 5,301 %, fällig 12.07.2028	299	0,31			
400 Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, Ewige Anleihe *	406	0,43			
250 Credit Agricole SA/London, 144A, 1,907 %, fällig 16.06.2026 *	230	0,24			
200 Societe Generale SA, 144A, 7,367 %, fällig 10.01.2053	202	0,21			
430 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 3,750 %, fällig 17.09.2024	410	0,43			
200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	142	0,15			
	4.446	4,69			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, fällig 15.01.2029	48	0,05	70 Edison International, Series A, 5,375 %, Ewige Anleihe *	64	0,07
230 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	151	0,16	280 El Paso Natural Gas Co LLC, 7,500 %, fällig 15.11.2026	297	0,31
140 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.03.2042	90	0,10	220 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	202	0,21
60 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	46	0,05	240 Elevance Health Inc, 5,500 %, fällig 15.10.2032	244	0,26
80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01.04.2061	47	0,05	50 Elevance Health Inc, 4,375 %, fällig 01.12.2047	43	0,04
90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,950 %, fällig 30.06.2062	54	0,06	50 Eli Lilly & Co, 4,875 %, fällig 27.02.2053	50	0,05
420 Chesapeake Energy Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2026	412	0,43	50 Eli Lilly & Co, 4,950 %, fällig 27.02.2063	50	0,05
40 Chevron USA Inc, 2,343 %, fällig 12.08.2050	25	0,03	40 Endeavor Energy Resources LP / EER Finance Inc, 144A, 5,750 %, fällig 30.01.2028	39	0,04
110 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	106	0,11	150 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	142	0,15
280 Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	234	0,25	80 Enterprise Products Operating LLC, Series D, 6,875 %, fällig 01.03.2033	89	0,09
110 Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	82	0,09	320 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	260	0,27
150 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	132	0,14	130 Enterprise Products Operating LLC, 3,300 %, fällig 15.02.2053	88	0,09
820 Citigroup Inc, 0,981 %, fällig 01.05.2025 *	775	0,82	80 Enterprise Products Operating LLC, 3,950 %, fällig 31.01.2060	59	0,06
50 Citigroup Inc, 3,980 %, fällig 20.03.2030 *	46	0,05	390 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	327	0,34
230 Citigroup Inc, 2,976 %, fällig 05.11.2030 *	196	0,21	150 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	144	0,15
580 Citigroup Inc, 2,561 %, fällig 01.05.2032 *	466	0,49	70 EQM Midstream Partners LP, 4,750 %, fällig 15.07.2023	69	0,07
210 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	183	0,19	100 EQM Midstream Partners LP, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2027	98	0,10
270 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	343	0,36	190 EQT Corp, 6,125 %, fällig 01.02.2025	190	0,20
90 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	81	0,08	130 EQT Corp, 5,678 %, fällig 01.10.2025	128	0,14
140 Clorox Co/The, 1,800 %, fällig 15.05.2030	112	0,12	60 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	55	0,06
70 Coca-Cola Co/The, 1,375 %, fällig 15.03.2031	55	0,06	100 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	92	0,10
50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	36	0,04	100 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	103	0,11
130 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	123	0,13	20 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	17	0,02
520 Comcast Corp, 4,650 %, fällig 15.02.2033	502	0,53	190 Equifax Inc, 2,350 %, fällig 15.09.2031	150	0,16
40 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	46	0,05	80 Extra Space Storage LP, 3,900 %, fällig 01.04.2029	73	0,08
91 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	101	0,11	40 Exxon Mobil Corp, 3,482 %, fällig 19.03.2030	37	0,04
60 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	49	0,05	30 Exxon Mobil Corp, 2,995 %, fällig 16.08.2039	23	0,02
30 Comcast Corp, 3,969 %, fällig 01.11.2047	24	0,03	110 Exxon Mobil Corp, 4,227 %, fällig 19.03.2040	99	0,10
202 Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	131	0,14	40 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	34	0,04
100 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	93	0,10	30 Exxon Mobil Corp, 3,452 %, fällig 15.04.2051	23	0,02
50 CommonSpirit Health, 2,782 %, fällig 01.10.2030	42	0,04	30 FirstEnergy Corp, Series C, 5,100 %, fällig 15.07.2047	27	0,03
60 CommonSpirit Health, 3,910 %, fällig 01.10.2050	46	0,05	450 Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 2,300 %, fällig 01.10.2031	354	0,37
150 Constellation Brands Inc, 5,000 %, fällig 02.02.2026	149	0,16	20 Ford Motor Co, 4,750 %, fällig 15.01.2043	15	0,02
40 Constellation Brands Inc, 3,700 %, fällig 06.12.2026	38	0,04	200 Ford Motor Credit Co LLC, 2,300 %, fällig 10.02.2025	184	0,19
50 Continental Resources Inc/OK, 4,500 %, fällig 15.04.2023	50	0,05	450 Ford Motor Credit Co LLC, 6,950 %, fällig 06.03.2026	451	0,48
70 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,268 %, fällig 15.11.2026	61	0,06	300 Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	261	0,28
240 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	223	0,23	100 Fortinet Inc, 2,200 %, fällig 15.03.2031	80	0,08
100 Continental Resources Inc/OK, 144A, 2,875 %, fällig 01.04.2032	76	0,08	200 Freeport-McMoRan Inc, 4,550 %, fällig 14.11.2024	196	0,21
20 Costco Wholesale Corp, 1,750 %, fällig 20.04.2032	16	0,02	150 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	141	0,15
360 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	338	0,36	40 GE Capital European Funding Unlimited Co, 6,025 %, fällig 01.03.2038	50	0,05
109 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	104	0,11	20 GE Capital UK Funding Unlimited Co, 8,000 %, fällig 14.01.2039	28	0,03
70 CVS Health Corp, 3,250 %, fällig 15.08.2029	62	0,06	130 General Motors Co, 4,875 %, fällig 02.10.2023	130	0,14
130 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	102	0,11	290 General Motors Co, 6,125 %, fällig 01.10.2025	293	0,31
10 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	9	0,01	70 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	67	0,07
360 CVS Health Corp, 2,700 %, fällig 21.08.2040	244	0,26	100 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	100	0,11
100 DCP Midstream Operating LP, 3,250 %, fällig 15.02.2032	83	0,09	70 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	63	0,07
30 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	31	0,03	40 General Motors Financial Co Inc, 3,700 %, fällig 09.05.2023	40	0,04
62 Dell International LLC / EMC Corp, 8,100 %, fällig 15.07.2036	69	0,07	630 Genting New York LLC / GENNY Capital Inc, 144A, 3,300 %, fällig 15.02.2026	551	0,58
320 Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.05.2025	327	0,34	70 Gilead Sciences Inc, 4,000 %, fällig 01.09.2036	62	0,06
10 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	10	0,01	150 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,250 %, fällig 21.10.2025	145	0,15
440 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	428	0,45	1.100 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	999	1,05
360 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	342	0,36	280 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	263	0,28
60 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	60	0,06	600 Goldman Sachs Group Inc/The, Series VAR, 1,093 %, fällig 09.12.2026 *	528	0,56
132 Devon Energy Corp, 5,875 %, fällig 15.06.2028	133	0,14	270 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	251	0,26
194 Devon Energy Corp, 4,500 %, fällig 15.01.2030	181	0,19	70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,800 %, fällig 15.03.2030	64	0,07
50 Devon Energy Corp, 7,950 %, fällig 15.04.2032	57	0,06	220 Goldman Sachs Group Inc/The, Series DMTN, 2,383 %, fällig 21.07.2032 *	173	0,18
80 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	74	0,08	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	144	0,15
150 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	127	0,13	50 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	46	0,05
260 Devon OEI Operating LLC, 7,500 %, fällig 15.09.2027	281	0,30	30 Halliburton Co, 2,920 %, fällig 01.03.2030	26	0,03
260 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	230	0,24	640 Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.01.2026	596	0,63
110 Diamondback Energy Inc, 4,400 %, fällig 24.03.2051	85	0,09	70 HCA Inc, 5,125 %, fällig 15.06.2039	62	0,07
180 Diamondback Energy Inc, 6,250 %, fällig 15.03.2053	177	0,19	100 Hershey Co/The, 1,700 %, fällig 01.06.2030	81	0,09
520 DISH DBS Corp, 5,000 %, fällig 15.03.2023	519	0,55	30 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	24	0,02
140 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	112	0,12	70 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	52	0,05
80 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 01.05.2024	72	0,08	180 Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	185	0,20
100 Edison International, 4,950 %, fällig 15.04.2025	99	0,10	50 Humana Inc, 4,950 %, fällig 01.10.2044	45	0,05
130 Edison International, Series B, 5,000 %, Ewige Anleihe *	112	0,12			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
380 ILFC E-Capital Trust I, 144A, 6,288 %, fällig 21.12.2065 *	261	0,28	50 Morgan Stanley, 1,794 %, fällig 13.02.2032 *	38	0,04
100 ILFC E-Capital Trust II, 144A, 6,538 %, fällig 21.12.2065 *	71	0,07	90 Morgan Stanley, 2,239 %, fällig 21.07.2032 *	70	0,07
100 Intel Corp, 2,800 %, fällig 12.08.2041	68	0,07	150 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	119	0,12
50 Intel Corp, 4,900 %, fällig 05.08.2052	44	0,05	50 Morgan Stanley, 6,342 %, fällig 18.10.2033 *	53	0,06
150 Intel Corp, 3,200 %, fällig 12.08.2061	94	0,10	360 Morgan Stanley, 2,484 %, fällig 16.09.2036 *	269	0,28
190 Intercontinental Exchange Inc, 4,600 %, fällig 15.03.2033	181	0,19	110 Morgan Stanley, 5,297 %, fällig 20.04.2037 *	103	0,11
40 Intercontinental Exchange Inc, 4,950 %, fällig 15.06.2052	38	0,04	100 Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	98	0,10
270 Invitation Homes Operating Partnership LP, 4,150 %, fällig 15.04.2032	238	0,25	20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	19	0,02
40 Jersey Central Power & Light Co, 144A, 4,300 %, fällig 15.01.2026	38	0,04	220 MPLX LP, 5,000 %, fällig 01.03.2033	207	0,22
120 Johnson & Johnson, 2,100 %, fällig 01.09.2040	82	0,09	300 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	256	0,27
60 Johnson & Johnson, 2,450 %, fällig 01.09.2060	37	0,04	290 National General Holdings Corp, Series 0000, 144A, 6,750 %, fällig 15.05.2024	291	0,31
710 JPMorgan Chase & Co, 5,546 %, fällig 15.12.2025 *	709	0,75	100 New York Life Global Funding, 144A, 4,550 %, fällig 28.01.2033	96	0,10
250 JPMorgan Chase & Co, 2,005 %, fällig 13.03.2026 *	233	0,25	60 New York Life Insurance Co, 144A, 3,750 %, fällig 15.05.2050	47	0,05
70 JPMorgan Chase & Co, 2,739 %, fällig 15.10.2030 *	59	0,06	280 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 6,051 %, fällig 01.03.2025	282	0,30
20 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	17	0,02	50 NextEra Energy Operating Partners LP, 144A, 4,250 %, fällig 15.07.2024	48	0,05
400 JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	336	0,35	100 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 1,050 %, fällig 08.03.2024	95	0,10
300 JPMorgan Chase & Co, 1,953 %, fällig 04.02.2032 *	233	0,25	60 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	50	0,05
260 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	211	0,22	310 Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	293	0,31
90 JPMorgan Chase & Co, 2,545 %, fällig 08.11.2032 *	72	0,08	120 Norfolk Southern Railway Co, 7,875 %, fällig 15.05.2043	142	0,15
380 JPMorgan Chase & Co, 4,586 %, fällig 26.04.2033 *	354	0,37	80 Northwest Pipeline LLC, 7,125 %, fällig 01.12.2025	82	0,09
80 JPMorgan Chase & Co, 4,260 %, fällig 22.02.2048 *	69	0,07	260 Northwest Pipeline LLC, 4,000 %, fällig 01.04.2027	246	0,26
70 JPMorgan Chase & Co, 3,964 %, fällig 15.11.2048 *	56	0,06	60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,850 %, fällig 30.09.2047	48	0,05
80 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	64	0,07	60 Northwestern Mutual Life Insurance Co/The, 144A, 3,625 %, fällig 30.09.2059	43	0,04
10 JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	7	0,01	90 Nuveen LLC, 144A, 4,000 %, fällig 01.11.2028	85	0,09
170 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650 %, Ewige Anleihe *	148	0,16	30 NVIDIA Corp, 3,500 %, fällig 01.04.2040	25	0,03
100 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021, 2,810 %, fällig 01.06.2041	73	0,08	30 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	23	0,02
70 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2019, 3,266 %, fällig 01.11.2049	52	0,05	50 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	54	0,06
20 Kaiser Foundation Hospitals, Series 2021, 3,002 %, fällig 01.06.2051	14	0,01	50 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	55	0,06
220 Kimco Realty OP LLC, 2,250 %, fällig 01.12.2031	171	0,18	100 Ohio Edison Co, 144A, 5,500 %, fällig 15.01.2033	100	0,11
40 Kinder Morgan Energy Partners LP, 7,300 %, fällig 15.08.2033	44	0,05	190 Ohio Edison Co, 6,875 %, fällig 15.07.2036	208	0,22
70 Kinder Morgan Inc, 5,300 %, fällig 01.12.2034	66	0,07	30 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,150 %, fällig 01.06.2032	28	0,03
60 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	52	0,05	10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 3,100 %, fällig 15.09.2049	7	0,01
90 KKR Group Finance Co III LLC, 144A, 5,125 %, fällig 01.06.2044	79	0,08	280 Oracle Corp, 6,250 %, fällig 09.11.2032	292	0,31
40 KKR Group Finance Co VII LLC, 144A, 3,625 %, fällig 25.02.2050	28	0,03	240 Oracle Corp, 4,000 %, fällig 15.07.2046	175	0,18
100 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	98	0,10	40 Oracle Corp, 6,900 %, fällig 09.11.2052	43	0,05
30 KLA Corp, 4,950 %, fällig 15.07.2052	28	0,03	280 Oracle Corp, 5,550 %, fällig 06.02.2053	257	0,27
280 Kyndryl Holdings Inc, 3,150 %, fällig 15.10.2031	209	0,22	60 Otis Worldwide Corp, 2,565 %, fällig 15.02.2030	51	0,05
190 Kyndryl Holdings Inc, 4,100 %, fällig 15.10.2041	128	0,14	130 Pacific Gas and Electric Co, 4,250 %, fällig 01.08.2023	129	0,14
90 Lam Research Corp, 1,900 %, fällig 15.06.2030	73	0,08	450 Pacific Gas and Electric Co, 3,150 %, fällig 01.01.2026	418	0,44
30 Lam Research Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2050	20	0,02	70 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	60	0,06
100 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	96	0,10	100 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.12.2027	89	0,09
70 Lennox International Inc, 1,700 %, fällig 01.08.2027	60	0,06	120 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	94	0,10
100 Lincoln National Corp, Series C, 9,250 %, Ewige Anleihe *	110	0,12	10 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	7	0,01
60 Lithia Motors Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.12.2027	55	0,06	60 Pacific Gas and Electric Co, 4,750 %, fällig 15.02.2044	47	0,05
80 Lowe's Cos Inc, 1,700 %, fällig 15.10.2030	62	0,07	40 Pacific Gas and Electric Co, 4,950 %, fällig 01.07.2050	32	0,03
80 Lowe's Cos Inc, 2,800 %, fällig 15.09.2041	54	0,06	170 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	156	0,16
100 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	64	0,07	60 PayPal Holdings Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2030	50	0,05
130 Mars Inc, 144A, 2,375 %, fällig 16.07.2040	90	0,09	150 PayPal Holdings Inc, 4,400 %, fällig 01.06.2032	141	0,15
190 Marsh & McLennan Cos Inc, 2,375 %, fällig 15.12.2031	153	0,16	10 PayPal Holdings Inc, 3,250 %, fällig 01.06.2050	7	0,01
40 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 3,375 %, fällig 15.04.2050	29	0,03	20 PayPal Holdings Inc, 5,050 %, fällig 01.06.2052	18	0,02
100 Massachusetts Mutual Life Insurance Co, 144A, 4,900 %, fällig 01.04.2077	87	0,09	160 PepsiCo Inc, 3,900 %, fällig 18.07.2032	151	0,16
110 Mastercard Inc, 3,350 %, fällig 26.03.2030	101	0,11	40 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	29	0,03
30 Mastercard Inc, 1,900 %, fällig 15.03.2031	24	0,03	90 Pilgrim's Pride Corp, 144A, 5,875 %, fällig 30.09.2027	88	0,09
60 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	51	0,05	130 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	103	0,11
80 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	66	0,07	50 Plains All American Pipeline LP, Series B, 8,974 %, Ewige Anleihe *	46	0,05
90 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.03.2047	78	0,08	40 Plains All American Pipeline LP / PAA Finance Corp, 6,700 %, fällig 15.05.2036	40	0,04
110 McDonald's Corp, 4,450 %, fällig 01.09.2048	96	0,10	190 PNC Financial Services Group Inc/The, Series W, 6,250 %, Ewige Anleihe *	184	0,19
130 MDC Holdings Inc, 2,500 %, fällig 15.01.2031	96	0,10	140 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	107	0,11
50 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	42	0,04	120 Prudential Financial Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2053 *	121	0,13
70 Merck & Co Inc, 2,350 %, fällig 24.06.2040	49	0,05	50 QUALCOMM Inc, 4,500 %, fällig 20.05.2052	45	0,05
80 Meta Platforms Inc, 3,850 %, fällig 15.08.2032	72	0,08	161 Range Resources Corp, 4,875 %, fällig 15.05.2025	157	0,17
70 Meta Platforms Inc, 4,450 %, fällig 15.08.2052	58	0,06	80 Range Resources Corp, 8,250 %, fällig 15.01.2029	82	0,09
190 Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032	144	0,15	50 Raymond James Financial Inc, 4,950 %, fällig 15.07.2046	46	0,05
120 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	116	0,12	630 Regal Rexnord Corp, 144A, 6,050 %, fällig 15.02.2026	625	0,66
154 Microsoft Corp, 3,450 %, fällig 08.08.2036	135	0,14	190 Republic Services Inc, 3,375 %, fällig 15.11.2027	176	0,19
59 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	42	0,04	80 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig 15.10.2026	69	0,07
360 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	360	0,38	50 S&P Global Inc, 1,250 %, fällig 15.08.2030	39	0,04
20 Molson Coors Beverage Co, 3,000 %, fällig 15.07.2026	19	0,02	30 S&P Global Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2049	22	0,02
60 Molson Coors Beverage Co, 4,200 %, fällig 15.07.2046	47	0,05	110 Salesforce Inc, 1,500 %, fällig 15.07.2028	93	0,10
40 Mondelez International Inc, 2,625 %, fällig 04.09.2050	25	0,03	140 San Diego Gas & Electric Co, Series VVV, 1,700 %, fällig 01.10.2030	110	0,12
570 Morgan Stanley, Series I, 0,864 %, fällig 21.10.2025 *	525	0,55			
130 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	121	0,13			
830 Morgan Stanley, 0,985 %, fällig 10.12.2026 *	730	0,77			
30 Morgan Stanley, 1,593 %, fällig 04.05.2027 *	26	0,03			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)	
	USD	% vom Nettoinventarwert		USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
USA – (Fortsetzung)					
140 San Diego Gas & Electric Co, Series RRR, 3,750 %, fällig 01.06.2047	109	0,12	23 Walt Disney Co/The, 6,400 %, fällig 15.12.2035	25	0,03
150 Southern California Edison Co, 2,250 %, fällig 01.06.2030	123	0,13	80 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	91	0,10
150 Southern California Edison Co, Series G, 2,500 %, fällig 01.06.2031	123	0,13	30 Walt Disney Co/The, 5,400 %, fällig 01.10.2043	30	0,03
10 Southern California Edison Co, 4,000 %, fällig 01.04.2047	8	0,01	10 Walt Disney Co/The, 4,950 %, fällig 15.10.2045	9	0,01
110 Southern California Edison Co, Series C, 4,125 %, fällig 01.03.2048	88	0,09	200 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,428 %, fällig 15.03.2024	195	0,21
70 Southern California Edison Co, 3,650 %, fällig 01.02.2050	52	0,05	120 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 4,279 %, fällig 15.03.2032	104	0,11
140 Southwest Airlines Co, 5,250 %, fällig 04.05.2025	139	0,15	280 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	227	0,24
40 Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	42	0,04	430 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052	337	0,36
30 Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig 01.02.2032	26	0,03	120 Waste Management Inc, 3,150 %, fällig 15.11.2027	111	0,12
120 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	121	0,13	110 Wells Fargo & Co, 2,406 %, fällig 30.10.2025 *	104	0,11
400 SVB Financial Group, 4,570 %, fällig 29.04.2033 *	361	0,38	300 Wells Fargo & Co, 4,540 %, fällig 15.08.2026 *	293	0,31
190 Targa Resources Corp, 5,200 %, fällig 01.07.2027	187	0,20	10 Wells Fargo & Co, 3,000 %, fällig 23.10.2026	9	0,01
180 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	157	0,17	10 Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	9	0,01
130 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	118	0,12	80 Wells Fargo & Co, 3,584 %, fällig 22.05.2028 *	74	0,08
120 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	102	0,11	60 Wells Fargo & Co, 3,068 %, fällig 30.04.2041 *	44	0,05
30 Target Corp, 3,375 %, fällig 15.04.2029	28	0,03	140 Wells Fargo & Co, 5,375 %, fällig 02.11.2043	133	0,14
450 TD SYNNEX Corp, 1,250 %, fällig 09.08.2024	421	0,44	120 Wells Fargo & Co, 4,750 %, fällig 07.12.2046	103	0,11
70 Teachers Insurance & Annuity Association of America, 144A, 4,270 %, fällig 15.05.2047	60	0,06	170 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	157	0,16
190 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.03.2027	200	0,21	330 Wells Fargo & Co, 4,611 %, fällig 25.04.2053 *	286	0,30
240 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 7,000 %, fällig 15.10.2028	255	0,27	60 Welltower OP LLC, 3,850 %, fällig 15.06.2032	52	0,05
40 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	34	0,04	150 Western Midstream Operating LP, 3,350 %, fällig 01.02.2025	142	0,15
80 Texas Instruments Inc, 2,250 %, fällig 04.09.2029	69	0,07	230 Western Midstream Operating LP, 3,950 %, fällig 01.06.2025	219	0,23
210 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	186	0,20	60 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 15.08.2048	50	0,05
254 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, fällig 15.07.2033	286	0,30	10 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	7	0,01
310 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	311	0,33	60 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	58	0,06
90 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	87	0,09		60.094	63,41
40 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	34	0,04	Sambia – 0,43 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
120 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	98	0,10	420 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2025	408	0,43
70 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	58	0,06	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 102.013 \$)		
120 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	94	0,10		91.131	96,16
180 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	146	0,15	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 1,69 % (28. Februar 2022: 9,07 %)		
20 T-Mobile USA Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2040	17	0,02	Chile – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,20 %)		
130 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	91	0,10	200 Internationale Anleihe der chilenischen Regierung, 2,550 %, fällig 27.07.2033	157	0,17
100 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	67	0,07	Mexiko – 1,20 % (28. Februar 2022: 1,06 %)		
195 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	207	0,22	MXN 12,140 Mexikanische Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	620	0,65
460 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,250 %, fällig 01.12.2026	480	0,51	290 Internationale mexikanische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 12.02.2034	237	0,25
30 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 4,450 %, fällig 01.08.2042	26	0,03	350 Internationale mexikanische Staatsanleihe, 4,280 %, fällig 14.08.2041	280	0,30
100 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	78	0,08		1.137	1,20
270 Truist Financial Corp, 1,267 %, fällig 02.03.2027 *	240	0,25	Panama – 0,21 % (28. Februar 2022: 0,24 %)		
70 Union Pacific Corp, 2,973 %, fällig 16.09.2062	44	0,05	270 Internationale Anleihe der panamesischen Regierung, 2,252 %, fällig 29.09.2032	202	0,21
60 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	44	0,05	Peru – 0,06 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
145 United Airlines 2020-1 Class B Pass Through Trust, 4,875 %, fällig 15.01.2026	140	0,15	70 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 2,783 %, fällig 23.01.2031	58	0,06
80 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	66	0,07	USA – 0,05 % (28. Februar 2022: 5,69 %)		
540 UnitedHealth Group Inc, 5,350 %, fällig 15.02.2033	553	0,58	50 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.02.2033	48	0,05
50 UnitedHealth Group Inc, 3,500 %, fällig 15.08.2039	41	0,04	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.891 \$)		
90 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	66	0,07		1.602	1,69
40 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.07.2045	38	0,04	Schuldscheindarlehen – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,85 %)		
30 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	27	0,03	143 SkyMiles IP Ltd, 8,558 %, fällig 16.09.2027 *	148	0,15
80 UnitedHealth Group Inc, 4,750 %, fällig 15.05.2052	74	0,08	177 United Airlines Inc, 8,568 %, fällig 14.04.2028 *	177	0,19
40 UnitedHealth Group Inc, 5,875 %, fällig 15.02.2053	43	0,05	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 318 \$)		
60 US Airways 2012-2 Class A Pass Through Trust, 4,625 %, fällig 03.06.2025	58	0,06		325	0,34
160 Verizon Communications Inc, 1,500 %, fällig 18.09.2030	124	0,13	Kommunalanleihen – 0,74 % (28. Februar 2022: 0,68 %)		
480 Verizon Communications Inc, 4,272 %, fällig 15.01.2036	424	0,45	50 Alabama Economic Settlement Authority, 3,163 %, fällig 15.09.2025	48	0,05
100 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	68	0,07	150 American Municipal Power Inc, 7,834 %, fällig 15.02.2041	191	0,20
60 Verizon Communications Inc, 2,850 %, fällig 03.09.2041	42	0,04	150 Port Authority of New York & New Jersey, 4,458 %, fällig 01.10.2062	137	0,15
40 Verizon Communications Inc, 6,550 %, fällig 15.09.2043	44	0,05	160 Regents of the University of California Medical Center Pooled Revenue, 4,132 %, fällig 15.05.2032	151	0,16
50 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	40	0,04	100 State of California, 7,300 %, fällig 01.10.2039	122	0,13
30 Verizon Communications Inc, 2,987 %, fällig 30.10.2056	18	0,02	50 State of Illinois, 5,100 %, fällig 01.06.2033	49	0,05
70 VICI Properties LP, 4,950 %, fällig 15.02.2030	65	0,07	Summe Kommunalanleihen (Anschaffungskosten 737 \$)		
60 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	51	0,05		698	0,74
50 Visa Inc, 2,700 %, fällig 15.04.2040	38	0,04			
150 Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	131	0,14			
310 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	254	0,27			
120 Walmart Inc, 1,800 %, fällig 22.09.2031	97	0,10			
100 Walmart Inc, 2,650 %, fällig 22.09.2051	68	0,07			
20 Walt Disney Co/The, 6,200 %, fällig 15.12.2034	22	0,02			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert	
Vorzugsaktien – 0,27 % (28. Februar 2022: 0,29 %)			
USA – 0,27 % (28. Februar 2022: 0,29 %)			
8 KeyCorp	206		0,22
1 Lincoln National Corp, Series D	20		0,02
1 Prudential Financial Inc	27		0,03
	253		0,27
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 252 \$)	253		0,27
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 105.415 \$)			
	94.192		99,39
Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2022: 0,08 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	35		0,04
Futures – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,12 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	4		0,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
	94.231		99,44
Credit Default Swaps – -0,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-74		-0,08
Devisenterminkontrakte – -0,43 % (28. Februar 2022: -0,99 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-404		-0,43
Futures – -0,11 % (28. Februar 2022: -0,09 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-103		-0,11
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
	-581		-0,62
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
	93.650		98,82
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.125		1,18
Gesamtvermögen	94.775 \$		100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Kauf	20. Juni 2027	1.040	\$ -29
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Kauf	20. Dez. 2027	460	-7
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 %	– Kauf	20. Dez. 2027	1.330	-14
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 %	– Kauf	20. Juni 2027	1.875	-24
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					-74
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					\$ -74

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.438	Verkauf GBP 2.015	\$ 13
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 67.107	Verkauf USD 81.103	-361
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf EUR 416	Verkauf USD 451	-9
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf MXN 3.333	Verkauf USD 168	12
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf JPY 64.420	Verkauf USD 511	-34
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf BRL 1.460	Verkauf USD 273	4
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 427	Verkauf GBP 350	6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 143 \$)				\$ 35
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.739 \$)				-404
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.596 \$)				\$ -369

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	4	\$ 447
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	17	1.992
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	-6	-1.222
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	104	11.134
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	10	1.252
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Bank of America Merrill Lynch	54	7.293
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 202 \$)			\$ 4
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -158 \$)			-103
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 44 \$)			\$ -99

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

- 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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 28.654.000 \$ und machten 30,18 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.
- † Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.
- ⊕ Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,54
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,33
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	3,09
Gesamtvermögen	100,00

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 2,61 % (28. Februar 2022: 3,57 %)			10 MEG Energy Corp, 144A, 5,875 %, fällig 01.02.2029		
260 Ameriquet Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Ctf Ser 2004-R10, Series 2004 R10, Class M6, 6,672 %, fällig 25.11.2034 *	222	1,20	40 Royal Bank of Canada, 1,150 %, fällig 10.06.2025	36	0,20
27 Ameriquet Mortgage Securities Trust 2006-R1, Series 2006 R1, Class M1, 5,202 %, fällig 25.03.2036 *	27	0,14	10 Teck Resources Ltd, 3,900 %, fällig 15.07.2030	9	0,05
49 RAMP Series 2006-RZ3 Trust, Series 2006 RZ3, Class M1, 4,967 %, fällig 25.08.2036 *	47	0,26	70 Toronto-Dominion Bank/The, 1,150 %, fällig 12.06.2025	64	0,34
100 Saxon Asset Securities Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A4, 5,097 %, fällig 25.10.2046 *	86	0,47		204	1,11
101 Soundview Home Loan Trust 2006-2, Series 2006 2, Class M2, 5,142 %, fällig 25.03.2036 *	99	0,54	Kolumbien – 0,36 % (28. Februar 2022: 0,40 %)		
			100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	66	0,36
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 521 \$)	481	2,61	Frankreich – 1,03 % (28. Februar 2022: 0,97 %)		
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 19,86 % (28. Februar 2022: 17,27 %)			200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	189	1,03
100 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class C, 4,013 %, fällig 15.09.2060 *	86	0,47	Irland – 0,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
7.834 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Series 2018 B7, Class XA, 0,426 %, fällig 15.05.2053 *	130	0,70	59 Avolon TLB Borrower 1 (US) LLC, 6,848 %, fällig 01.12.2027 *	59	0,32
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 7,234 %, fällig 25.12.2041 *	94	0,51	Israel – 1,21 % (28. Februar 2022: 1,04 %)		
19 Fannie Mae Pool 'AM8700', 2,930 %, fällig 01.06.2030	17	0,09	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	119	0,64
19 Fannie Mae Pool 'AN5386', 3,250 %, fällig 01.05.2029	18	0,10	120 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	105	0,57
21 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	19	0,10		224	1,21
40 Fannie Mae Pool 'BM6898', 2,149 %, fällig 01.02.2032 *	33	0,18	Macau – 0,93 % (28. Februar 2022: 0,79 %)		
86 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01.03.2051	71	0,38	200 Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	171	0,93
129 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 01.02.2050	114	0,62	Mexiko – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
89 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 01.10.2051	79	0,43	100 Southern Copper Corp, 5,250 %, fällig 08.11.2042	94	0,51
182 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 01.11.2051	161	0,88	Vereinigtes Königreich – 1,25 % (28. Februar 2022: 0,35 %)		
92 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, fällig 01.12.2051	79	0,43	40 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	36	0,20
290 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 01.09.2048	276	1,50	40 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	29	0,15
90 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 01.10.2051	77	0,42	200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	166	0,90
89 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	79	0,43		231	1,25
90 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01.07.2051	74	0,40	USA – 22,39 % (28. Februar 2022: 20,29 %)		
92 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	76	0,41	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	10	0,05
89 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 01.12.2051	77	0,42	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,05
189 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	175	0,95	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	20	0,11
75 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 01.10.2050	62	0,33	100 AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	96	0,52
85 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 01.04.2051	70	0,38	80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	71	0,38
76 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	65	0,35	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	17	0,09
86 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig 01.09.2051	73	0,40	10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,05
72 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	58	0,31	20 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	16	0,09
18 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	15	0,08	20 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	12	0,07
350 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01.12.2049	321	1,74	32 Altria Group Inc, 4,400 %, fällig 14.02.2026	31	0,17
91 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig 01.11.2051	77	0,42	8 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	8	0,04
95 Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class M2, 144A, 6,467 %, fällig 25.02.2050 *	96	0,52	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	18	0,10
104 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class M2, 144A, 6,134 %, fällig 25.01.2034 *	103	0,56	30 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	27	0,15
145 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20.05.2050	139	0,75	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	32	0,17
233 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20.07.2051	209	1,13	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	32	0,17
249 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	223	1,21	50 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	43	0,23
94 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig 20.02.2052	87	0,47	10 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	8	0,04
100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	99	0,54	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	18	0,10
98 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	5	0,03	40 Boeing Co/The, 4,875 %, fällig 01.05.2025	39	0,21
36 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM2R, Series 2021 NQ2R, Class A3, 144A, 1,353 %, fällig 25.10.2058 *	32	0,17	50 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	48	0,26
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B2, 144A, 3,497 %, fällig 25.06.2057 *	193	1,05	40 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	38	0,21
			50 Boeing Co/The, 5,805 %, fällig 01.05.2050	48	0,26
Summe hypotheckenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.088 \$)	3.662	19,86	40 BP Capital Markets America Inc, 3,119 %, fällig 04.05.2026	38	0,21
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 31,20 % (28. Februar 2022: 27,98 %)			20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	18	0,10
Australien – 0,42 % (28. Februar 2022: 0,30 %)			20 BP Capital Markets America Inc, 3,000 %, fällig 24.02.2050	14	0,07
20 BHP Billiton Finance USA Ltd, 5,000 %, fällig 30.09.2043	19	0,10	13 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	12	0,06
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	20	0,11	260 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	206	1,12
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	38	0,21	10 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	9	0,05
	77	0,42	10 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	9	0,05
Belgien – 0,29 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,908 %, fällig 23.07.2025	39	0,21
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	36	0,20	80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	74	0,40
20 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,350 %, fällig 01.06.2040	18	0,09	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	34	0,18
	54	0,29	10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,125 %, fällig 01.07.2049	8	0,04
Brasilien – 1,38 % (28. Februar 2022: 1,75 %)			40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,800 %, fällig 01.03.2050	29	0,16
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	105	0,57	10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	8	0,04
60 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	47	0,26	40 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	38	0,21
100 Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 21.11.2036	103	0,55	20 Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	18	0,10
	255	1,38	20 Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	18	0,10
Kanada – 1,11 % (28. Februar 2022: 0,96 %)			150 Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	150	0,82
30 Bank of Montreal, 1,850 %, fällig 01.05.2025	28	0,15	200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	164	0,89
20 Bank of Nova Scotia/The, 1,300 %, fällig 11.06.2025	18	0,10	10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	13	0,07
20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	20	0,11	50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	45	0,24
20 Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,950 %, fällig 23.06.2023	20	0,11	50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	33	0,18
			40 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	38	0,21
			10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	9	0,05

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Indonesien – 2,35 % (28. Februar 2022: 2,20 %)		
USA – (Fortsetzung)			200 Internationale indonesische Staatsanleihe, 4,625 %, fällig 15.04.2043		
60 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	55	0,30	IDR 1.145.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR59, 7,000 %, fällig 15.05.2027	76	0,41
30 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	26	0,14	IDR 2.677.000 Indonesische Schatzanleihe, Series FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	173	0,94
150 Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	155	0,84		433	2,35
160 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	152	0,82	Mexiko – 7,42 % (28. Februar 2022: 6,36 %)		
40 Devon Energy Corp, 5,850 %, fällig 15.12.2025	40	0,22	MXN 25.890 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042		
40 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	34	0,18	200 Internationale mexikanischen Staatsanleihe, 4,350 %, fällig 15.01.2047		
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	18	0,10		155	0,84
10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026	8	0,05		1.369	7,42
30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	28	0,15	Peru – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,29 %)		
20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	20	0,11	30 Internationale Anleihe der peruanischen Regierung, 6,550 %, fällig 14.03.2037		
20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	19	0,10		32	0,17
10 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Ewige Anleihe *	9	0,05	Russland – 0,12 % (28. Februar 2022: 0,84 %)		
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	19	0,10	RUB 33,741 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029 tr		
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	19	0,10		22	0,12
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	141	0,76	USA – 15,97 % (28. Februar 2022: 21,99 %)		
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	10	0,05	240 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033 β		
10 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	9	0,05	60 United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.12.2025	53	0,29
230 Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	215	1,16	10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	9	0,05
220 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	184	1,00	280 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.12.2027	237	1,28
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	18	0,10	210 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 29.02.2028	181	0,98
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	18	0,10	10 United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.08.2030	8	0,04
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	32	0,17	10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	8	0,05
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	18	0,10	230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	159	0,87
10 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	10	0,05	10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	8	0,04
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	8	0,04	90 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	89	0,48
20 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	17	0,09	50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	41	0,22
40 Las Vegas Sands Corp, 3,200 %, fällig 08.08.2024	39	0,21	50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	36	0,20
10 MDC Holdings Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	8	0,05	200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	115	0,62
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	24	0,13	230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	141	0,76
99 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	99	0,54	470 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	307	1,67
40 Mondelez International Inc, 1,500 %, fällig 04.05.2025	37	0,20	630 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	463	2,51
110 Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026 *	103	0,56	50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	34	0,18
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	62	0,34	370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	241	1,31
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	19	0,10	152 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	108	0,59
20 MPLX LP, 5,500 %, fällig 15.02.2049	18	0,10	367 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	301	1,63
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	16	0,08	160 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	134	0,73
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	37	0,20	40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	41	0,22
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	20	0,11		2.945	15,97
20 PepsiCo Inc, 1,625 %, fällig 01.05.2030	16	0,09	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.765 \$)		
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01.05.2030	16	0,09		5.046	27,36
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	17	0,09	Schuldscheindarlehen – 5,39 % (28. Februar 2022: 7,67 %)		
40 Raytheon Technologies Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	33	0,18	51 1011778 BC ULC, 6,320 %, fällig 14.11.2026 *	51	0,28
10 Raytheon Technologies Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	9	0,05	59 Allied Universal Holdco LLC, 8,411 %, fällig 14.05.2028 *	57	0,31
60 Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 20.09.2025	60	0,33	10 AmWINS Group, Inc., 6,820 %, fällig 17.02.2028 *	10	0,05
10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	9	0,05	20 Brown Group Holding LLC, 7,047 %, fällig 07.06.2028 *	20	0,11
10 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.02.2026	9	0,05	69 Charter Communications Operating LLC, 6,320 %, fällig 30.04.2025 *	68	0,37
10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	9	0,05	49 Citadel Securities, 7,176 %, fällig 27.02.2028 *	49	0,27
10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	9	0,05	10 DCert Buyer, Inc., 8,696 %, fällig 16.10.2026 *	10	0,05
70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	57	0,31	44 Energizer Holdings, Inc., 6,928 %, fällig 16.12.2027 *	44	0,24
10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	8	0,04	20 Gainwell Acquisition Corp, 8,730 %, fällig 01.10.2027 *	19	0,10
20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	17	0,09	69 Genesee & Wyoming Inc, 6,730 %, fällig 30.12.2026 *	68	0,37
20 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 7,850 %, fällig 01.02.2026	21	0,11	65 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 6,570 %, fällig 15.11.2027 *	64	0,35
50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	39	0,21	10 GVC Holdings Gibraltar Ltd, 7,230 %, fällig 16.03.2027 *	10	0,05
40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	31	0,17	59 Harbor Freight Tools USA Inc, 7,320 %, fällig 19.10.2027 *	57	0,31
10 United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	9	0,05	50 Hunter Douglas Inc, 7,859 %, fällig 09.02.2029 *	46	0,25
20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	18	0,10	24 ICON Luxembourg S.a.r.l., 7,000 %, fällig 01.07.2028 *	24	0,13
40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	33	0,18	9 iHeartCommunications Inc, 7,570 %, fällig 01.05.2026 *	9	0,05
20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	15	0,08	6 Indigo Merger Sub, Inc., 7,000 %, fällig 01.07.2028 *	6	0,03
20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	16	0,09	36 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 8,070 %, fällig 22.04.2028 *	35	0,19
40 US Bancorp, 1,450 %, fällig 12.05.2025	37	0,20	35 Nexstar Broadcasting Inc, 7,070 %, fällig 19.09.2026 *	35	0,19
10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	9	0,05	20 Quikrete Holdings, Inc., 7,570 %, fällig 11.06.2028 *	20	0,11
20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	17	0,09	10 Rackspace Technology Global, Inc, 7,595 %, fällig 09.02.2028 *	6	0,03
30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,15	60 Sotera Health, 7,575 %, fällig 13.12.2026 *	58	0,31
140 Western Midstream Operating LP, 5,500 %, fällig 01.02.2050	114	0,62	29 Station Casinos LLC, 6,820 %, fällig 08.02.2027 *	29	0,16
20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01.03.2048	17	0,09	18 UFC Holdings LLC, 7,570 %, fällig 29.04.2026 *	18	0,10
10 Workday Inc, 3,500 %, fällig 01.04.2027	9	0,05	29 United Airlines Inc, 8,568 %, fällig 14.04.2028 *	29	0,16
10 Workday Inc, 3,700 %, fällig 01.04.2029	9	0,05	10 Univision Communications Inc, 7,820 %, fällig 24.03.2026 *	10	0,05
	4.130	22,39	69 Verscend Holding Corp., 8,570 %, fällig 27.08.2025 *	69	0,37
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.987 \$)	5.754	31,20	60 Virgin Media Bristol LLC, 7,088 %, fällig 04.01.2028 *	59	0,32
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 27,36 % (28. Februar 2022: 33,90 %)			15 Zebra Buyer LLC, 7,750 %, fällig 22.04.2028 *	15	0,08
Brasilien – 1,33 % (28. Februar 2022: 1,98 %)			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 1.014 \$)		
BRL 579 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	91	0,50		995	5,39
200 Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 5,000 %, fällig 27.01.2045	154	0,83			
	245	1,33			

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,28 % (28. Februar 2022: 5,54 %)					
1.342 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.342	7,28	– U.S. 5 Year April 2023 Call 109.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.342 \$)	1.342	7,28	– U.S. 5 Year April 2023 Call 109.75, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 20.717 \$)	17.280	93,70	– U.S. 5 Year April 2023 Call 110.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	– U.S. 5 Year April 2023 Call 110.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–
Gekaufte Optionen – 0,11 % (28. Februar 2022: 0,02 %)			– U.S. 5 Year April 2023 Put 108.25, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-3	-0,02
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 96.00, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	17	0,10	– U.S. Bond April 2023 Call 128.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
– Euro Currency Future März 2023 Call 1.08, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	–	–	– U.S. Bond April 2023 Put 124.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Call 76.00, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	–	–	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -39 \$)	-38	-0,21
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.25, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	2	0,01	Index-Swaps – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2	-0,01
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 20 \$)	19	0,11	Devisenterminkontrakte – 0,31 % (28. Februar 2022: -0,86 %)		
Credit Default Swaps – 0,31 % (28. Februar 2022: 0,78 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-58	-0,31
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	57	0,31	Futures – -0,65 % (28. Februar 2022: -2,43 %)		
Index-Swaps – 4,56 % (28. Februar 2022: 1,09 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-120	-0,65
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	842	4,56	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-218	-1,18
Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2022: 0,55 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	18.147	98,41
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	11	0,06	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	294	1,59
Futures – 0,85 % (28. Februar 2022: 0,87 %)			Gesamtvermögen	18.441 \$	100,00
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	156	0,85			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	18.365	99,59			
Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Verkaufte Optionen – -0,21 % (28. Februar 2022: -0,37 %)					
– 1-Year Mid-Curve 3 Month SOFR Futures Dezember 2023 Put 95.3750, fällig 15.12.2023 – Morgan Stanley	-16	-0,09			
– Japanese Yen Currency Future März 2023 Put 77.00, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	-4	-0,02			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 112.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-2	-0,01			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 113.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-3	-0,02			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 113.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	-0,01			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 114.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 115.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 116.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 10 Year April 2023 Call 117.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 10 Year April 2023 Put 115.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-3	-0,02			
– U.S. 10 Year Juni 2023 Call 115.00, fällig 26.05.2023 – Morgan Stanley	-1	–			
– U.S. 10 Year W1 März 2023 Call 112.00, fällig 03.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 107.75, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.00, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	-1	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.50, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			
– U.S. 5 Year April 2023 Call 108.75, fällig 24.03.2023 – Morgan Stanley	–	–			

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2027	490	\$ 8
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2027	4.702	49
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 171 \$)					\$ 57
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 171 \$)					\$ 57

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,130 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	613	\$ 83
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,220 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2028	122	16
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,520 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2047	325	98
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,630 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Mai 2047	1.540	440
Morgan Stanley	Pay Fixed 1,650 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Aug. 2047	73	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,000 %, Receive Floating USD SOFR Compound	18. März 2032	239	30
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,500 %, Receive Floating USD SOFR Compound	21. Apr. 2052	150	21
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,600 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	285	37
Morgan Stanley	Pay Fixed 2,850 %, Receive Floating USD SOFR Compound	15. Feb. 2029	377	20
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,050 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	15. Feb. 2048	139	7
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,250 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Sep. 2029	568	17
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,270 %, Receive Floating USD SOFR Compound	30. Apr. 2029	1.665	52
Morgan Stanley	Pay Fixed 3,850 %, Receive Floating USD SOFR OIS Compound	30. Juni 2029	1.002	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 238 \$)				\$ 842
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)				-2
Nettowertsteigerung von Index-Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 238 \$)				\$ 840

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
18. Apr. 2023	BNP Paribas	Kauf USD 156	Verkauf EUR 144	\$ 3
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf USD 223	Verkauf MXN 4.418	-16
18. Apr. 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY 9.295	Verkauf USD 71	-2
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 669	Verkauf CNH 4.585	7
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf IDR 439.327	Verkauf USD 28	1
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf CAD 1.012	Verkauf USD 757	-16
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf NOK 1.920	Verkauf EUR 181	-6
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 38	Verkauf GBP 31	–
18. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf AUD 771	Verkauf USD 538	-18
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 120 \$)				\$ 11
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (189))\$				-58
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): (69))\$				\$ -47

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2023	Morgan Stanley -40	\$ -9.475	\$ 82
3 Month SOFR Index Dezember 2024	Morgan Stanley -20	-4.809	13
3 Month SOFR Index Dezember 2025	Morgan Stanley 4	966	2
3 Month SOFR Index September 2023	Morgan Stanley 2	473	-3
90 Day Euro\$ März 2023	Morgan Stanley 1	237	–
Australia 10 Year Bond März 2023	Morgan Stanley 5	396	-16
Australian Dollar Currency März 2023	Morgan Stanley 3	202	-4
Euro FX Currency März 2023	Morgan Stanley 3	397	-5
Euro-Bund März 2023	Morgan Stanley 1	141	-5
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Morgan Stanley -1	-142	28
Euro-OAT März 2023	Morgan Stanley 2	270	-20
Fed Fund 30 Day Februar 2023	Morgan Stanley -10	-3.976	-1
Japanese Yen Currency März 2023	Morgan Stanley 4	368	-4
Long Gilt Juni 2023	Morgan Stanley 2	240	-1
Mexican Peso Currency März 2023	Morgan Stanley 7	191	12
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley 15	1.675	-1
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2023	Morgan Stanley -9	-1.055	-1
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley -9	-1.834	3
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley 112	11.990	-30
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley -18	-2.254	16
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley 31	4.187	-29
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 191 \$)			\$ 156
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -533 \$)			-120
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -342 \$)			\$ 36

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^A

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023			Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023			
Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 86,70 % (28. Februar 2022: 92,11 %)						
Australien – 1,16 % (28. Februar 2022: 1,25 %)						
EUR 100 AusNet Services Holdings Pty Ltd, 1,625 %, fällig 11.03.2081 *	89	0,99	GBP 200 Standard Chartered Plc, 144A, 2,608 %, fällig 12.01.2028 *	178	1,98	
20 Westpac Banking Corp, 2,668 %, fällig 15.11.2035 *	16	0,17	100 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 2,500 %, fällig 02.05.2025	114	1,27	
	105	1,16		1.184	13,16	
Belgien – 2,09 % (28. Februar 2022: 2,46 %)			USA – 27,59 % (28. Februar 2022: 29,46 %)			
EUR 100 Elia Transmission Belgium SA, 3,625 %, fällig 18.01.2033	103	1,14	50 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	44	0,49	
EUR 100 UCB SA, 1,000 %, fällig 30.03.2028	85	0,95	60 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	55	0,61	
	188	2,09	100 Air Lease Corp, 1,875 %, fällig 15.08.2026	87	0,97	
Kanada – 0,94 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,11	
90 Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, fällig 08.06.2032	85	0,94	20 Amgen Inc, 5,250 %, fällig 02.03.2033	20	0,22	
Dänemark – 3,39 % (28. Februar 2022: 2,14 %)			20 Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	20	0,22	
200 Danske Bank A/S, 144A, 5,375 %, fällig 12.01.2024	199	2,22	130 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	89	0,99	
EUR 100 Orsted AS, 3,625 %, fällig 01.03.2026	106	1,17	60 Bank of America Corp, 3,550 %, fällig 05.03.2024 *	60	0,67	
	305	3,39	80 Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041 *	55	0,61	
Finnland – 1,01 % (28. Februar 2022: 1,09 %)			19 Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	18	0,19	
EUR 100 Neste Oyj, 0,750 %, fällig 25.03.2028	90	1,01	40 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	37	0,41	
Frankreich – 8,18 % (28. Februar 2022: 10,08 %)			60 Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	50	0,56	
EUR 100 AXA SA, 5,125 %, fällig 04.07.2043 *	106	1,18	60 Cigna Group/The, 3,400 %, fällig 15.03.2050	42	0,47	
230 BNP Paribas SA, 144A, 3,052 %, fällig 13.01.2031 *	195	2,16	60 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	76	0,85	
EUR 100 Engie SA, 0,500 %, fällig 24.10.2030	81	0,91	50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	33	0,36	
EUR 200 GELF Bond Issuer I SA, 1,125 %, fällig 18.07.2029	166	1,84	90 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	86	0,96	
EUR 100 Orange SA, 5,000 %, Ewige Anleihe *	106	1,18	80 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	72	0,80	
EUR 100 Terega SA, 0,875 %, fällig 17.09.2030	82	0,91	20 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	17	0,19	
	736	8,18	30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	28	0,31	
Deutschland – 9,60 % (28. Februar 2022: 9,38 %)			70 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	59	0,65	
200 Allianz SE, 3,200 %, Ewige Anleihe *	151	1,68	30 Exelon Corp, 3,400 %, fällig 15.04.2026	28	0,31	
EUR 100 alstria office REIT-AG, 1,500 %, fällig 15.11.2027	77	0,86	70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,375 %, fällig 27.03.2025	73	0,82	
EUR 100 Amprion GmbH, 3,971 %, fällig 22.09.2032	105	1,17	80 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	74	0,83	
60 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	71	0,79	80 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	69	0,77	
EUR 100 Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *	83	0,92	10 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	26	0,29	
EUR 100 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	96	1,06	10 Humana Inc, 5,875 %, fällig 01.03.2033	10	0,11	
EUR 100 Sirius Real Estate Ltd, 1,125 %, fällig 22.06.2026	85	0,95	100 JPMorgan Chase & Co, 1,090 %, fällig 11.03.2027 *	96	1,07	
EUR 120 Volkswagen Financial Services AG, 1,500 %, fällig 01.10.2024	122	1,36	50 Lowe's Cos Inc, 3,000 %, fällig 15.10.2050	32	0,35	
EUR 100 Vonovia SE, 0,750 %, fällig 01.09.2032	73	0,81	70 McDonald's Corp, 3,700 %, fällig 30.01.2026	68	0,75	
	863	9,60	120 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	87	0,96	
Irland – 1,33 % (28. Februar 2022: 1,44 %)			100 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	89	0,99	
150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	120	1,33	10 Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	10	0,11	
Italien – 4,25 % (28. Februar 2022: 4,79 %)			30 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	26	0,29	
150 Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07.10.2039	143	1,59	EUR 100 Prologis Euro Finance LLC, 3,875 %, fällig 31.01.2030	103	1,14	
200 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	151	1,68	30 Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	22	0,25	
EUR 100 Terna – Rete Elettrica Nazionale, 2,375 %, Ewige Anleihe *	89	0,98	100 Schneider Electric SE, 3,375 %, fällig 13.04.2034	103	1,14	
	383	4,25	80 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	71	0,79	
Niederlande – 4,04 % (28. Februar 2022: 4,23 %)			90 UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029	85	0,95	
EUR 80 ABN AMRO Bank NV, 1,000 %, fällig 16.04.2025	80	0,90	120 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	117	1,30	
EUR 200 Cooperatieve Rabobank UA, 3,250 %, Ewige Anleihe *	180	2,00	90 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	81	0,90	
EUR 100 ING Groep NV, 2,500 %, fällig 15.02.2029 *	103	1,14	20 Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,050 %, fällig 15.03.2042	16	0,18	
	363	4,04	EUR 100 Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig 02.02.2027	94	1,04	
Portugal – 1,02 % (28. Februar 2022: 1,05 %)			60 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	55	0,62	
EUR 100 EDP – Energias de Portugal SA, 1,875 %, fällig 02.08.2081 *	91	1,02	130 Williams Cos Inc/The, 3,500 %, fällig 15.10.2051	89	0,99	
Südafrika – 2,16 % (28. Februar 2022: 2,18 %)				2.482	27,59	
200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	194	2,16	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.466 \$)			
Spanien – 1,67 % (28. Februar 2022: 1,89 %)				7.798	86,70	
EUR 100 Acciona Energia Financiacion Filiales SA, 1,375 %, fällig 26.01.2032	87	0,96	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 8,26 % (28. Februar 2022: 2,87 %)			
60 Telefonica Emisiones SA, 7,045 %, fällig 20.06.2036	63	0,71	Deutschland – 3,90 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
	150	1,67	EUR 100 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2029	92	1,02	
Schweden – 1,18 % (28. Februar 2022: 1,14 %)			EUR 90 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	81	0,90	
EUR 100 Svenska Handelsbanken AB, 1,250 %, fällig 02.03.2028 *	106	1,18	EUR 70 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 03, 4,750 %, fällig 04.07.2034	89	0,99	
Schweiz – 3,93 % (28. Februar 2022: 4,36 %)			EUR 70 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	89	0,99	
200 Credit Suisse Group AG, 6,375 %, Ewige Anleihe *†	148	1,65		351	3,90	
EUR 200 UBS Group AG, 1,500 %, fällig 30.11.2024	205	2,28	USA – 4,36 % (28. Februar 2022: 2,87 %)			
	353	3,93	140 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	133	1,48	
Vereinigtes Königreich – 13,16 % (28. Februar 2022: 13,23 %)			50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	46	0,51	
EUR 100 Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig 12.07.2024	101	1,12	40 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	36	0,40	
GBP 100 Associated British Foods Plc, 2,500 %, fällig 16.06.2034	96	1,07	10 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	10	0,11	
EUR 100 Barclays Plc, 3,375 %, fällig 02.04.2025 *	105	1,17	112 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	80	0,89	
GBP 100 Barclays Plc, 1,700 %, fällig 03.11.2026 *	109	1,21	40 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	33	0,37	
200 HSBC Holdings Plc, 4,950 %, fällig 31.03.2030	193	2,14	40 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	34	0,37	
GBP 100 Lloyds Banking Group Plc, 1,985 %, fällig 15.12.2031 *	103	1,14	20 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	20	0,23	
EUR 100 Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	89	0,99		392	4,36	
EUR 100 SSE Plc, 4,000 %, Ewige Anleihe *	96	1,07	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 806 \$)			
				743	8,26	
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,33 % (28. Februar 2022: 0,65 %)			
			30 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)			0,33
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 30 \$)			0,33
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 10.302 \$)			8,571 95,29

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Devisenterminkontrakte – 1,02 % (28. Februar 2022: 2,73 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	92	1,02
Futures – 0,66 % (28. Februar 2022: 0,21 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	59	0,66
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	8.722	96,97
Devisenterminkontrakte – -1,18 % (28. Februar 2022: -0,26 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-107	-1,18
Futures – -0,05 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-5	-0,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-112	-1,23
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	8.610	95,74
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	385	4,26
Gesamtnettovermögen	8.995 \$	100,00

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

144A Von der Eintragung gemäß Vorschrift 144A des US-Wertpapiergesetzes von 1933 (in seiner jeweils letzten Fassung) befreite Wertpapiere. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.076.000 \$ und machten 11,97 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

† Illiquide zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr.

‡ Das Wertpapier ist zum oder nach dem am 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr in Verzug (entweder Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf BRL	\$ 28
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	Verkauf USD	-76
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf EUR	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD	Verkauf GBP	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP	Verkauf USD	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR	Verkauf USD	-2
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL	Verkauf USD	-29
16. Mai 2023	BNP Paribas	Kauf USD	Verkauf EUR	2
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf EUR	27
16. Mai 2023	Citi	Kauf USD	Verkauf GBP	3
16. Mai 2023	Citi	Kauf EUR	Verkauf USD	–
16. Mai 2023	Goldman Sachs	Kauf USD	Verkauf EUR	28
16. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD	Verkauf EUR	2
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf EUR	2
16. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf USD	Verkauf GBP	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 270 \$)				\$ 92
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -26 \$)				-107
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 244 \$)				\$ -15

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2023	Morgan Stanley	\$ -731	\$ 27
Euro-Bund März 2023	Morgan Stanley	-141	5
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Morgan Stanley	-142	27
Long Gilt Juni 2023	Morgan Stanley	120	-1
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	857	-3
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	501	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21 \$)			\$ 59
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): - \$)			-5
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21 \$)			\$ 54

[^] 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 2023

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 14,55 % (28. Februar 2022: 7,64 %)				USA – 29,58 % (28. Februar 2022: 24,77 %)					
Deutschland – 5,33 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				10.720 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 3,334 %, fällig 31.07.2024 *					
8.900	Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig 19.10.2023	8.630	5,33	27.980	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	18.206	11,24		
Supranational – 9,22 % (28. Februar 2022: 7,64 %)				12.910 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052					
RUB	368,000 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	3.254	2,01	11.640	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	9.788	6,04		
ZAR	56,200 International Bank for Reconstruction & Development, 6,500 %, fällig 21.01.2027	2.852	1,76				47.920	29,58	
RUB	349,000 International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig 21.01.2027	3.038	1,87	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 166.098 \$)					
MXN	62,000 International Bank for Reconstruction & Development, 7,250 %, fällig 21.01.2027	3.097	1,91				136.659	84,35	
BRL	15,600 International Bank for Reconstruction & Development, 9,500 %, fällig 09.02.2029	2.705	1,67	Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,53 % (28. Februar 2022: 1,92 %)					
			14.946	9,22	4.095 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class			4.095	2,53
			23.576	14,55	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.095 \$)				
			23.576	14,55				4.095	2,53
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 84,35 % (28. Februar 2022: 90,20 %)				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 197.297 \$)					
Brasilien – 4,34 % (28. Februar 2022: 3,35 %)				Devisenterminkontrakte: 1,94 % (28. Februar 2022: 1,98 %)					
BRL	38,410 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2025	7.033	4,34	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			3.132	1,94	
Kanada – 2,83 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
CAD	6,500 Province of Manitoba Canada, 2,450 %, fällig 02.06.2025	4.585	2,83				167.462	103,37	
Chile – 0,87 % (28. Februar 2022: 0,74 %)				Devisenterminkontrakte: -2,45 % (28. Februar 2022: -2,08 %)					
	1.690 Internationale Anleihe der chilenischen Regierung, 2,450 %, fällig 31.01.2031	1.413	0,87	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-3.966	-2,45	
Kolumbien – 4,89 % (28. Februar 2022: 4,14 %)				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
COP	51,000,000 Colombian TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	7.920	4,89				-3.966	-2,45	
Deutschland – 5,44 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
EUR	9,000 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	8.814	5,44				163.496	100,92	
Mexiko – 13,18 % (28. Februar 2022: 10,64 %)				Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten					
MXN	94,700 Mexikanische Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	4.952	3,06				-1.487	-0,92	
MXN	101,000 Mexikanische Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	5.157	3,18	Gesamtvermögen					
MXN	99,700 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	4.675	2,89				162.009 \$	100,00	
MXN	137,000 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	6.568	4,05						
			21.352	13,18					
Neuseeland – 1,27 % (28. Februar 2022: 4,10 %)									
NZD	2,370 Neuseeländische Staatsanleihe, Series 0534, 4,250 %, fällig 15.05.2034	1.420	0,88						
NZD	1,480 Neuseeländische Staatsanleihe, Series 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	642	0,39						
			2.062	1,27					
Norwegen – 3,78 % (28. Februar 2022: 4,30 %)									
NOK	63,700 Norwegische Staatsanleihe, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	6.120	3,78						
Polen – 4,34 % (28. Februar 2022: 5,99 %)									
PLN	46,010 Staatsanleihe der Republik Polen, Series 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	7.036	4,34						
Südafrika – 4,06 % (28. Februar 2022: 4,07 %)									
ZAR	92,900 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	3.188	1,97						
ZAR	79,600 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series R2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	3.382	2,09						
			6.570	4,06					
Südkorea – 5,42 % (28. Februar 2022: 5,42 %)									
KRW	13,300,000 Koreanische Schatzanleihe, Series 4412, 2,750 %, fällig 10.12.2044	8.781	5,42						
Vereinigtes Königreich – 4,35 % (28. Februar 2022: 5,31 %)									
GBP	5,940 United Kingdom Gilt, 0,750 %, fällig 22.07.2023	7.053	4,35						

– 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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 6.120.000 \$ und machten 3,78 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ABKÜRZUNGEN:

BRL	–	Brasilianischer Real
CAD	–	Kanadischer Dollar
COP	–	Kolumbianischer Peso
EUR	–	Euro
GBP	–	Britisches Pfund Sterling
KRW	–	Südkoreanischer Won
MXN	–	Mexikanischer Peso
NOK	–	Norwegische Krone
NZD	–	Neuseeländischer Dollar
PLN	–	Polnischer Zloty
RUB	–	Russischer Rubel
ZAR	–	Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,02
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,40
Finanzderivate	1,84
Sonstige Vermögenswerte	1,74
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3. März 2023	HSBC	Kauf	USD	1.834	Verkauf	GBP	1.490	\$ 41
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	8.919	Verkauf	GBP	7.410	5
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	8.900	Verkauf	USD	10.941	-235
6. März 2023	HSBC	Kauf	USD	5.121	Verkauf	CLP	4.510.000	-323
6. März 2023	HSBC	Kauf	USD	4.307	Verkauf	CLP	3.470.000	118
6. März 2023	HSBC	Kauf	CLP	7.980.000	Verkauf	USD	8.781	852
7. März 2023	HSBC	Kauf	AUD	520	Verkauf	USD	350	1
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	4.130	Verkauf	AUD	6.070	44
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	6.660	Verkauf	USD	4.625	-142
8. März 2023	Citi	Kauf	USD	4.746	Verkauf	KRW	6.170.000	79
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	-	Verkauf	AUD	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	98	Verkauf	AUD	172	3
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	358	Verkauf	AUD	559	4
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	545	Verkauf	AUD	786	16
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	695	Verkauf	CAD	932	12
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	458	Verkauf	CAD	663	(2)
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	-	Verkauf	CAD	1	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	126	Verkauf	CAD	204	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	-	Verkauf	CNY	1	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.464	Verkauf	CNY	9.920	33
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	264	Verkauf	CNY	2.158	7
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	963	Verkauf	CNY	7.056	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	CNY	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	71	Verkauf	DKK	530	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	-	Verkauf	DKK	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	108	Verkauf	DKK	745	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	20	Verkauf	DKK	163	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	15	Verkauf	EUR	3	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	3	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	8	Verkauf	EUR	6	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	23	Verkauf	EUR	2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	52	Verkauf	EUR	49	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.066	Verkauf	EUR	2.304	45
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	31	Verkauf	EUR	19	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	11.744	Verkauf	EUR	10.867	242
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	26	Verkauf	EUR	6	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	4	Verkauf	EUR	2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	32	Verkauf	EUR	4	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	1	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	351	Verkauf	EUR	47	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	196	Verkauf	EUR	8	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	34	Verkauf	EUR	25	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	28	Verkauf	EUR	3	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	-	Verkauf	EUR	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	24	Verkauf	EUR	2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	27.005	Verkauf	EUR	187	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	6.869	Verkauf	GBP	43	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	5	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	3	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	3	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	4	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.694	Verkauf	GBP	1.406	5
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	49	Verkauf	GBP	2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	-	Verkauf	GBP	-	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	110	Verkauf	GBP	94	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	5	Verkauf	GBP	-	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	2	Verkauf	GBP	–	\$ –
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	–	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	6	Verkauf	GBP	4	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	–	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	5	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	93	Verkauf	GBP	10	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	7	Verkauf	GBP	5	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	3	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	–	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.184	Verkauf	GBP	1.061	-25
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	GBP	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	116	Verkauf	ILS	398	7
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	ILS	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	ILS	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	77	Verkauf	ILS	283	4
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	21	Verkauf	ILS	87	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	3.511	Verkauf	JPY	499.103	44
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5.334	Verkauf	JPY	701.458	174
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	JPY	9	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	962	Verkauf	JPY	152.690	35
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	JPY	1	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	MXN	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	185	Verkauf	MXN	3.842	-13
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	MXN	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	50	Verkauf	MXN	1.176	-3
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	282	Verkauf	MXN	5.399	-13
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NOK	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	NOK	670	1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	44	Verkauf	NOK	477	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	NOK	147	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	52	Verkauf	NZD	87	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	77	Verkauf	NZD	122	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	NZD	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	13	Verkauf	NZD	26	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	28	Verkauf	PLN	147	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	PLN	1	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	PLN	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	155	Verkauf	PLN	678	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	102	Verkauf	PLN	482	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	12	Verkauf	SEK	150	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	66	Verkauf	SEK	692	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	SEK	1	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SEK	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	44	Verkauf	SEK	491	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	28	Verkauf	SGD	45	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	–	Verkauf	SGD	–	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	102	Verkauf	SGD	146	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	155	Verkauf	SGD	204	3
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	41.357	Verkauf	USD	304	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	27	Verkauf	USD	6	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	77	Verkauf	USD	52	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	16	Verkauf	USD	5	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK	65	Verkauf	USD	7	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	27.836	Verkauf	USD	207	-2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK	72	Verkauf	USD	10	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	91	Verkauf	USD	67	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	3.119	Verkauf	USD	3.765	-11
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	11.909	Verkauf	USD	12.857	-255
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	7	Verkauf	USD	4	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD	5	Verkauf	USD	3	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	20	Verkauf	USD	15	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY	968	Verkauf	USD	140	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN	498	Verkauf	USD	27	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	39	Verkauf	USD	9	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS	24	Verkauf	USD	7	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	65	Verkauf	USD	7	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	–	Verkauf	USD	–	–
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	1.955	Verkauf	JPY	265.000	5
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	JPY	4.953.000	Verkauf	USD	36.706	-252
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	AUD	21	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.262	Verkauf	EUR	1.174	\$ 18
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	946	Verkauf	GBP	781	6
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	126	Verkauf	GBP	105	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	10.810	Verkauf	USD	13.063	-58
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1	Verkauf	USD	1	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	589	Verkauf	USD	410	-13
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	4.001	Verkauf	USD	4.299	-66
20. März 2023	Citi	Kauf	USD	6.673	Verkauf	NOK	65.800	329
20. März 2023	HSBC	Kauf	USD	1.838	Verkauf	NZD	2.940	20
20. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	1.234	Verkauf	NOK	12.200	58
20. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	78.000	Verkauf	USD	8.039	-520
21. März 2023	Barclays	Kauf	USD	2.234	Verkauf	MYR	9.800	47
21. März 2023	Barclays	Kauf	MYR	9.800	Verkauf	USD	2.287	-101
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	6.771	Verkauf	SEK	69.700	96
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	SEK	69.700	Verkauf	USD	6.752	-77
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	6.234	Verkauf	BRL	32.300	121
20. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	1.207	Verkauf	PLN	5.280	24
25. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	4.772	Verkauf	CAD	6.350	116
25. Apr. 2023	Citi	Kauf	CAD	6.350	Verkauf	USD	4.717	-60
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	4.069	Verkauf	COP	19.180.000	169
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	COP	6.540.000	Verkauf	USD	1.421	-91
28. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	20.933	Verkauf	MXN	401.700	-774
28. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf	MXN	14.000	Verkauf	USD	733	23
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	26.090	Verkauf	USD	28.518	-814
12. März 2023	HSBC	Kauf	THB	50.200	Verkauf	USD	1.505	-74
15. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	9.699	Verkauf	ZAR	173.500	313
17. Mai 2023	HSBC	Kauf	CNH	11.070	Verkauf	USD	1.639	-38
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.267 \$)							\$	3.132
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4.493 \$)								-3.966
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -226 \$)							\$	-834

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 21,89 % (28. Februar 2022: 5,38 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen: 5,67 % (28. Februar 2022: 0,10 %)		
991	Angel Oak Mortgage Trust 2019-6, Series 2019 6, Class A1, 144A, 2,620 %, fällig 25.11.2059 *	0,18	30.565	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	5,67
4.559	Angel Oak Mortgage Trust 2020-1, Series 2020 1, Class A1, 144A, 2,466 %, fällig 25.12.2059 *	0,80	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 30.565 \$)	30.565	5,67
11.380	COMM 2017-COR2 Mortgage Trust, Series 2017 COR2, Class A3, 3,510 %, fällig 10.09.2050	1,96	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 556.208 \$)	538.707	99,90
4.950	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 3,935 %, fällig 10.10.2029 *	0,84	Devisenterminkontrakte: 2,41 % (28. Februar 2022: 2,92 %)		
11.711	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 01.09.2052	2,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	13.024	2,41
4.126	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig 01.10.2052	0,75	Futures: 0,41 % (28. Februar 2022: 0,17 %)		
10.506	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig 01.12.2052	1,92	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	2.190	0,41
10.839	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,000 %, fällig 01.12.2052	2,01	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	553.921	102,72
4.079	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig 01.08.2052	0,74	Devisenterminkontrakte: -4,38 % (28. Februar 2022: -2,95 %)		
8.118	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig 01.09.2052	1,45	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-23.627	-4,38
6.606	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig 01.10.2052	1,18	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-23.627	-4,38
5.889	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig 01.11.2052	1,07	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	530.294	98,34
16.467	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,000 %, fällig 01.12.2052	3,05	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	8.977	1,66
8.350	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2017-C34, Series 2017 C34, Class A3, 3,276 %, fällig 15.11.2052	1,42	Gesamtnettovermögen	539.271	
EUR	1,650 Newgate Funding Plc, Series 2007 1X, Class BB, 2,204 %, fällig 01.12.2050 *	0,29	\$		100,00
EUR	2,578 Newgate Funding Plc, Series 2007 2X, Class BB, 2,296 %, fällig 15.12.2050 *	0,46			
	2.570 Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class A2, 144A, 3,875 %, fällig 25.05.2058 *	0,44			
	7.154 Towd Point Mortgage Trust 2018-5, Series 2018 5, Class A1, 144A, 3,250 %, fällig 25.07.2058 *	1,24			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 122.579 \$)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
118.046			21,89		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 7,26 % (28. Februar 2022: 19,33 %)			144A Wertpapiere		
Australien: 4,87 % (28. Februar 2022: 3,62 %)			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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 45.083.000 \$ und machten 8,37 % des Nettovermögens aus.		
15.460	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, fällig 14.03.2025 *	2,88	*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.	
10.640	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	1,99			
		26.271			
USA: 2,39 % (28. Februar 2022: 8,23 %)			ABKÜRZUNGEN:		
10.300	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig 01.11.2024	1,92	BRL	– Brasilianischer Real	
3.065	Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	0,47	COP	– Kolumbianischer Peso	
		12.888	EUR	– Euro	
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 39.410 \$)			MXN	– Mexikanischer Peso	
39.159			NZD	– Neuseeländischer Dollar	
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 65,08 % (28. Februar 2022: 70,51 %)			PEN	– Peruanischer Nuevo Sol	
Brasilien: 7,30 % (28. Februar 2022: 5,12 %)			PLN	– Polnischer Zloty	
BRL	158,800 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	4,76	ZAR	– Südafrikanischer Rand	
BRL	87,000 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	2,54			
		39.348			
Kolumbien: 5,75 % (28. Februar 2022: 3,16 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
COP	40,660,000 Kolumbianische TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	1,17	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		89,50
COP	63,090,000 Kolumbianische TES, Series B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	1,74	Organismen für gemeinsame Anlagen		5,38
COP	135,410,000 Kolumbianische TES, Series B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	2,84	Finanzderivate		2,68
		31.019	Sonstige Vermögenswerte		2,44
Mexiko: 5,75 % (28. Februar 2022: 6,24 %)			Gesamtvermögen		
MXN	183,800 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	1,63	100,00		
MXN	465,600 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	4,12			
		31.005			
Neuseeland: 2,68 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
NZD	33,290 Neuseeländische Staatsanleihe, Series 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	2,68			
Peru: 3,69 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PEN	86,000 Peruanische Staatsanleihe, 6,150 %, fällig 12.08.2032	3,69			
Polen: 4,28 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
PLN	150,900 Staatsanleihe der Republik Polen, Series 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	4,28			
Südafrika: 2,91 % (28. Februar 2022: 3,96 %)					
ZAR	369,800 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series R2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	2,91			
USA: 32,72 % (28. Februar 2022: 32,83 %)					
46.165	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 3,334 %, fällig 31.07.2024 *	8,56			
3.710	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,936 %, fällig 31.01.2025 *	0,69			
139.260	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	23,47			
		176.441			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 363.654 \$)					
350.937			65,08		

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
6. März 2023	HSBC	Kauf	USD	22.303	Verkauf	CLP	18.840.000	\$	-441
6. März 2023	HSBC	Kauf	CLP	18.840.000	Verkauf	USD	20.732		2.012
7. März 2023	Barclays	Kauf	USD	27.453	Verkauf	AUD	39.910		590
7. März 2023	Barclays	Kauf	AUD	40.230	Verkauf	USD	28.640		-1.561
7. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	27.772	Verkauf	AUD	40.230		694
7. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	AUD	15.670	Verkauf	USD	10.544		3
8. März 2023	Citi	Kauf	USD	26.504	Verkauf	KRW	33.800.000		942
8. März 2023	Citi	Kauf	KRW	33.800.000	Verkauf	USD	25.997		-435
10. März 2023	HSBC	Kauf	USD	30.842	Verkauf	THB	1.063.300		725
10. März 2023	HSBC	Kauf	THB	1.063.300	Verkauf	USD	30.820		-702
13. März 2023	Barclays	Kauf	USD	28.163	Verkauf	CHF	25.920		601
13. März 2023	Citi	Kauf	CHF	10.740	Verkauf	USD	11.492		-71
13. März 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	49.260	Verkauf	CHF	45.180		1.216
13. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	767	Verkauf	CHF	700		22
14. März 2023	Citi	Kauf	USD	10.881	Verkauf	JPY	1.419.000		437
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	15.674	Verkauf	JPY	2.115.000		108
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	JPY	2.808.000	Verkauf	USD	21.471		-804
14. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	5.140	Verkauf	JPY	693.000		40
14. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	JPY	1.419.000	Verkauf	USD	11.213		-769
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	GBP	4		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	10.227	Verkauf	USD	12.360		-55
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	125.381	Verkauf	USD	134.748		-2.007
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	246.873	Verkauf	USD	171.679		-5.460
20. März 2023	Barclays	Kauf	USD	16.735	Verkauf	NZD	25.790		788
20. März 2023	Barclays	Kauf	NZD	43.680	Verkauf	USD	28.430		-1.421
20. März 2023	Goldman Sachs	Kauf	USD	54.011	Verkauf	NZD	84.740		1.615
20. März 2023	Goldman Sachs	Kauf	NOK	217.000	Verkauf	USD	22.016		-1.097
20. März 2023	Goldman Sachs	Kauf	NZD	41.060	Verkauf	USD	26.165		-777
20. März 2023	JP Morgan	Kauf	NZD	2.060	Verkauf	USD	1.305		-31
20. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	NZD	18.090	Verkauf	USD	11.157		28
20. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	281.400	Verkauf	USD	28.945		-1.817
14. Apr. 2023	Barclays	Kauf	SEK	286.700	Verkauf	USD	27.789		-333
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	27.447	Verkauf	SEK	286.700		-9
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	30.537	Verkauf	BRL	159.380		372
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	BRL	89.670	Verkauf	USD	17.395		-424
20. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	22.429	Verkauf	PLN	98.120		452
20. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.703	Verkauf	PLN	7.460		32
25. Apr. 2023	Citi	Kauf	CAD	21.600	Verkauf	USD	16.043		-204
25. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	CAD	700	Verkauf	USD	526		-13
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	COP	23.680.000	Verkauf	USD	4.740		76
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	COP	79.560.000	Verkauf	USD	17.281		-1.101
28. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	20.922	Verkauf	MXN	401.500		-773
28. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	10.700	Verkauf	MXN	207.700		-523
5. Mai 2023	Citi	Kauf	EUR	50.930	Verkauf	USD	55.905		-1.825
5. Mai 2023	HSBC	Kauf	EUR	25.440	Verkauf	USD	27.764		-751
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	USD	60.850	Verkauf	EUR	55.670		1.737
9. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	19.966	Verkauf	PEN	77.000		-223
15. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	16.531	Verkauf	ZAR	295.700		534
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 21.946 \$)								\$	13.024
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -22.185 \$)									-23.627
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -239 \$)								\$	-10.603

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Morgan Stanley	-209	\$ -225.110	\$ 2.086
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Morgan Stanley	473	52.813	104
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.272 \$)				\$ 2.190
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4.865 \$)				-
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -3.593 \$)				\$ 2.190

[^] 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 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 95,87 % (28. Februar 2022: 91,17 %)					
Australien: 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
45 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	38	0,37	40 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	37	0,35
Brasilien: 2,19 % (28. Februar 2022: 4,98 %)					
295 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	228	2,19	70 NFP Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.10.2030	67	0,64
Kanada: 3,28 % (28. Februar 2022: 2,60 %)					
245 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	222	2,13	75 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,450 %, fällig 15.03.2023	75	0,72
130 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	119	1,15	80 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875 %, fällig 21.09.2023	79	0,76
	341	3,28	100 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	92	0,88
China: 1,88 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200 Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	195	1,88	35 PDC Energy Inc, 6,125 %, fällig 15.09.2024	35	0,33
Kolumbien: 1,29 % (28. Februar 2022: 3,21 %)					
180 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	134	1,29	205 PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig 15.05.2026	196	1,89
Finnland: 0,28 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
30 Nokia Oyj, 6,625 %, fällig 15.05.2039	29	0,28	40 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2031	32	0,31
Israel: 3,42 % (28. Februar 2022: 2,46 %)					
80 Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	78	0,75	120 Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	97	0,94
100 Energiean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	90	0,87	30 PRA Group Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2025	30	0,29
50 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	48	0,46	20 PRA Group Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	20	0,19
149 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	140	1,34	105 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	89	0,86
	356	3,42	30 QVC Inc, 4,750 %, fällig 15.02.2027	19	0,18
Mexiko: 1,49 % (28. Februar 2022: 5,19 %)					
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	154	1,49	75 QVC Inc, 4,375 %, fällig 01.09.2028	42	0,40
Nigeria: 1,58 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
200 IHS Holding Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 29.11.2028	165	1,58	70 Radian Group Inc, 4,500 %, fällig 01.10.2024	69	0,66
Puerto Rico: 0,53 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
55 Popular Inc, 6,125 %, fällig 14.09.2023	55	0,53	55 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	45	0,44
Vereinigtes Königreich: 2,55 % (28. Februar 2022: 5,36 %)					
45 British Airways 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, fällig 15.12.2032	38	0,37	175 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	185	1,78
245 Connect Finco SARR / Connect US Finco LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.10.2026	227	2,18	50 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	45	0,43
	265	2,55	40 Sabre Global Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.04.2025	39	0,38
USA: 77,01 % (28. Februar 2022: 57,01 %)					
50 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	48	0,46	105 Sabre Global Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2025	98	0,95
365 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	326	3,14	100 Signature Bank/New York NY, 4,000 %, fällig 15.10.2030 *	91	0,88
115 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	113	1,09	105 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	104	1,00
310 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	239	2,30	25 Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,375 %, fällig 15.07.2030	21	0,20
380 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	301	2,90	55 Station Casinos LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.02.2028	49	0,47
100 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	93	0,90	50 Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031	41	0,39
45 Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, fällig 12.08.2025	42	0,41	55 Synchrony Financial, 7,250 %, fällig 02.02.2033	53	0,51
220 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	190	1,83	100 Syneco Health Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	83	0,79
140 Cargo Aircraft Management Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2028	122	1,17	85 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, fällig 06.05.2031 *	76	0,73
110 Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	96	0,92	130 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	128	1,24
160 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	140	1,35	75 Travel + Leisure Co, 144A, 4,500 %, fällig 01.12.2029	63	0,61
55 Civitas Resources Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2026	51	0,49	65 Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2030	55	0,53
100 Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, fällig 01.11.2029	64	0,61	200 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2026	181	1,74
155 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	145	1,40	55 Twilio Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2029	46	0,44
165 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	155	1,49	155 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	157	1,51
15 DraftKings Holdings Inc, Nullkupon, fällig 15.03.2028	11	0,10	45 United States Cellular Corp, 6,700 %, fällig 15.12.2033	41	0,39
205 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	182	1,75	145 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	128	1,23
55 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	47	0,46	195 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	162	1,55
275 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	235	2,26	105 Vector Group Ltd, 5,750 %, fällig 01.02.2029	90	0,87
180 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	147	1,41	280 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	241	2,32
85 GrubHub Holdings Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.07.2027	67	0,65	85 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	78	0,75
105 Hightower Holding LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2029	89	0,86	152 Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	141	1,36
155 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	128	1,23	355 Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	378	3,63
50 Hyundai Capital America, 144A, 2,100 %, fällig 15.09.2028	41	0,40	45 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, fällig 15.06.2031 *	39	0,38
210 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	194	1,87	100 WMG Acquisition Corp, 2,250 %, fällig 15.08.2031	79	0,76
75 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	31	0,29	220 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	171	1,65
250 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2026	240	2,31	60 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	58	0,56
210 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	194	1,86		8.004	77,01
75 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	64	0,62	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 10.136 \$)		
45 Nathan's Famous Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.11.2025	45	0,43		9.964	95,87
20 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	19	0,18	Organismen für gemeinsame Anlagen: 3,81 % (28. Februar 2022: 4,64 %)		
			396 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	396	3,81
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 396 \$)		
				396	3,81
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 10.532 \$)		
				10.360	99,68
			Devisenterminkontrakte: 0,10 % (28. Februar 2022: 0,44 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				10	0,10
			Futures: 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				2	0,01
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
				10.372	99,79
			Devisenterminkontrakte: -1,94 % (28. Februar 2022: -0,18 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-202	-1,94
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-202	-1,94
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
				10.170	97,85
			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				224	2,15
			Gesamtvermögen		
				10.394 \$	100,00

[^] 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 2023 – (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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.039.000 \$ und machten 77,37 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	92,17
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,66
Finanzderivate	0,11
Sonstige Vermögenswerte	4,06
Gesamtvermögen	100,00

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3. März 2023	JP Morgan	Kauf USD 168	Verkauf GBP 140	\$ –
3. März 2023	JP Morgan	Kauf GBP 140	Verkauf USD 169	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF –	Verkauf CAD –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK –	Verkauf CAD –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK –	Verkauf CAD –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF –	Verkauf CAD –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 4	Verkauf CAD 6	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 44	Verkauf CAD 62	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 205	Verkauf CAD 277	3
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf CHF –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 3	Verkauf CHF 2	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 2.499	Verkauf EUR 1.724	7
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 10	Verkauf EUR 11	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 247	Verkauf GBP 153	-3
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR –	Verkauf GBP –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK –	Verkauf GBP –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2	Verkauf GBP 2	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF –	Verkauf GBP –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP –	Verkauf SEK –	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 3	Verkauf SEK 22	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 46	Verkauf USD 55	–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf CAD 11.079	Verkauf USD 8.266	-146
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf EUR 1.680	Verkauf USD 1.836	-53
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf GBP 150	Verkauf USD 181	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 50 \$)				\$ 10
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -20 \$)				-202
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 30 \$)				\$ -192

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2023	Citi	4	\$ 447
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)			\$ 2
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)			\$ 2

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 13,19 % (28. Februar 2022: 0,90 %)					
1.625	Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig 01.10.2052	1.599	0,78		
3.427	Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig 01.12.2052	3.373	1,64		
3.885	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 01.12.2052	3.885	1,89		
1.552	Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig 01.08.2052	1.528	0,74		
1.908	Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig 01.11.2052	1.877	0,92		
5.414	Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig 01.12.2052	5.412	2,64		
9.442	Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, fällig 20.10.2052	9.349	4,56		
EUR	44 IM Pastor 4 FTA 4, Class A, 2,221 %, fällig 22.03.2044 *	40	0,02		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 26.895 \$)		27.063	13,19		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 6,05 % (28. Februar 2022: 18,49 %)					
Australien: 4,12 % (28. Februar 2022: 3,73 %)					
4.260	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, fällig 14.03.2025 *	4.279	2,08		
4.140	Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	4.179	2,04		
		8.458	4,12		
USA: 1,93 % (28. Februar 2022: 8,07 %)					
3.930	Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, fällig 28.06.2024 *	3.951	1,93		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 12.321 \$)		12.409	6,05		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 78,56 % (28. Februar 2022: 78,35 %)					
Brasilien: 5,44 % (28. Februar 2022: 5,18 %)					
BRL	29,620 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2027	5.180	2,53		
BRL	9,240 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	1.545	0,75		
BRL	9,230 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.492	0,73		
BRL	18,690 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	2.940	1,43		
		11.157	5,44		
Kanada: 0,74 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
CAD	2,110 Kanadische Staatsanleihe, 2,000 %, fällig 01.09.2023	1.527	0,74		
Kolumbien: 5,87 % (28. Februar 2022: 3,29 %)					
COP	12,600,000 Kolumbianische TES, Series B, 6,250 %, fällig 26.11.2025	2.241	1,09		
COP	21,200,000 Kolumbianische TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	3.292	1,60		
COP	14,690,000 Kolumbianische TES, Series B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	2.146	1,05		
COP	24,290,000 Kolumbianische TES, Series B, 9,250 %, fällig 28.05.2042	3.609	1,76		
COP	6,640,000 Kolumbianische TES, Series B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	752	0,37		
		12.040	5,87		
Deutschland: 5,84 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
EUR	1,450 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, fällig 15.05.2023	1.530	0,74		
EUR	10,680 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	10.460	5,10		
		11.990	5,84		
Malaysia: 2,82 % (28. Februar 2022: 4,45 %)					
MYR	13,430 Malaysische Staatsanleihe, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	2.993	1,46		
MYR	2,630 Malaysische Staatsanleihe, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	593	0,29		
MYR	9,735 Malaysische Staatsanleihe, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	2.192	1,07		
		5.778	2,82		
Mexiko: 12,40 % (28. Februar 2022: 9,09 %)					
MXN	111,600 Mexikanische Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	5.836	2,84		
MXN	118,500 Mexikanische Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	6.051	2,95		
MXN	116,700 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	5.472	2,67		
MXN	80,300 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	3.849	1,88		
MXN	88,900 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	4.238	2,06		
		25.446	12,40		
Neuseeland: 0,82 % (28. Februar 2022: 4,01 %)					
NZD	3,860 Neuseeländische Staatsanleihe, Series 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051	1.673	0,82		
Norwegen: 0,74 % (28. Februar 2022: 4,13 %)					
NOK	15,800 Norwegische Staatsanleihe, Series 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	1.518	0,74		
Polen: 4,04 % (28. Februar 2022: 8,75 %)					
PLN	54,170 Staatsanleihe der Republik Polen, Series 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	8.284	4,04		
Russland: 0,03 % (28. Februar 2022: 0,17 %)					
RUB	83,000 Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, 0,000 %, fällig 10.04.2030 †	55	0,03		
Südafrika: 3,69 % (28. Februar 2022: 4,13 %)					
ZAR	108,600 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	3.727	1,82		
ZAR	90,500 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	3.845	1,87		
		7.572	3,69		
Südkorea: 6,80 % (28. Februar 2022: 7,17 %)					
KRW	15,700,000 Koreanische Schatzanleihe, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	10.415	5,07		
KRW	6,600,000 Koreanische Schatzanleihe, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	3.542	1,73		
		13.957	6,80		
Vereinigtes Königreich: 0,76 % (28. Februar 2022: 5,08 %)					
GBP	1,310 United Kingdom Gilt, 0,750 %, fällig 22.07.2023	1.556	0,76		
USA: 28,57 % (28. Februar 2022: 6,30 %)					
7.080	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 3,334 %, fällig 31.07.2024 *	7.078	3,45		
11.700	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,936 %, fällig 31.01.2025 *	11.713	5,71		
5.660	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	4.796	2,34		
23.370	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	15.206	7,41		
14.370	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	10.251	5,00		
11.380	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	9.570	4,66		
		58.614	28,57		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 192.944 \$)		161.167	78,56		
Organismen für gemeinsame Anlagen: 1,99 % (28. Februar 2022: 1,36 %)					
4.087	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	4.087	1,99		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.087 \$)		4.087	1,99		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 236.247 \$)		204.726	99,79		
Devisenterminkontrakte: 0,71 % (28. Februar 2022: 1,17 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1.448	0,71		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		206.174	100,50		
Devisenterminkontrakte: -2,07 % (28. Februar 2022: -1,67 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		-4.239	-2,07		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		-4.239	-2,07		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		201.935	98,43		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		3.211	1,57		
Gesamtnettovermögen		205.146 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 13.927.000 \$ und machten 6,79 % des Nettovermögens aus.					
* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.					
† Nicht liquide.					
γ Aufgrund der Ungewissheit der Zinszahlungen werden während und/oder nach dem zum 28. Februar 2023 endenden Geschäftsjahr keine Erträge aus dem Wertpapier mehr gezahlt.					
ABKÜRZUNGEN:					
BRL	– Brasilianischer Real				
CAD	– Kanadischer Dollar				
COP	– Kolumbianischer Peso				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
KRW	– Südkoreanischer Won				
MXN	– Mexikanischer Peso				
MYR	– Malaysischer Ringgit				
NOK	– Norwegische Krone				
NZD	– Neuseeländischer Dollar				
PLN	– Polnischer Zloty				
RUB	– Russischer Rubel				
ZAR	– Südafrikanischer Rand				
Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens			
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		91,58			
Organismen für gemeinsame Anlagen		1,87			
Finanzderivate		0,66			
Sonstige Vermögenswerte		5,89			
Gesamtvermögen		100,00			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
3. März 2023	HSBC	Kauf	GBP 4.930	Verkauf	USD 6.066	\$ -136
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD 15.254	Verkauf	GBP 12.670	14
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	GBP 7.740	Verkauf	USD 9.532	-222
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD 5.041	Verkauf	AUD 7.410	54
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	AUD 7.410	Verkauf	USD 5.146	-158
8. März 2023	Citi	Kauf	USD 7.415	Verkauf	KRW 9.640.000	124
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 366	Verkauf	AUD 335	1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 34	Verkauf	AUD 60	1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 44	Verkauf	CAD 70	1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 468	Verkauf	CAD 397	-2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 985	Verkauf	CNY 4.222	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD -	Verkauf	CNY 1	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 92	Verkauf	CNY 749	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 73	Verkauf	DKK 317	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 7	Verkauf	DKK 56	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 699	Verkauf	EUR 779	15
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 7.518	Verkauf	EUR 4.397	-6
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS 2	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK 2	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD -	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD -	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 47	Verkauf	GBP 40	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NOK 2	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 1.107	Verkauf	GBP 582	-14
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN 2	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY 2.051	Verkauf	GBP 12	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD 3	Verkauf	GBP 2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 30	Verkauf	GBP 26	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 3	Verkauf	GBP 1	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY 29	Verkauf	GBP 3	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN 15	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK 2	Verkauf	GBP -	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 78	Verkauf	ILS 169	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 8	Verkauf	ILS 30	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 3.590	Verkauf	JPY 298.606	23
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 333	Verkauf	JPY 52.914	12
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 18	Verkauf	MXN 408	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 189	Verkauf	MXN 2.301	-8
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 5	Verkauf	NOK 51	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 44	Verkauf	NOK 285	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	DKK 13	Verkauf	NZD 3	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	MXN 89	Verkauf	NZD 8	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD 3	Verkauf	NZD 5	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 11	Verkauf	NZD 2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 284	Verkauf	NZD 456	2
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY 12.326	Verkauf	NZD 147	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNY 173	Verkauf	NZD 41	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	ILS 8	Verkauf	NZD 3	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 5	Verkauf	NZD 9	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 180	Verkauf	NZD 307	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK 11	Verkauf	NZD 2	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN 12	Verkauf	NZD 5	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 23	Verkauf	NZD 45	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD 16	Verkauf	NZD 19	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD 14	Verkauf	NZD 15	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 105	Verkauf	PLN 289	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	PLN 52	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 44	Verkauf	SEK 294	-1
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 4	Verkauf	SEK 52	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 9	Verkauf	SGD 15	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 105	Verkauf	SGD 87	-
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	NZD 11.147	Verkauf	USD 7.057	-164
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 1.036	Verkauf	USD 1.250	-3
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	JPY 5.913.000	Verkauf	USD 43.820	-301
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD -	Verkauf	EUR -	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD 13	Verkauf	GBP 11	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP -	Verkauf	USD -	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP 123	Verkauf	USD 149	-1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR 1	Verkauf	USD 1	-
20. März 2023	HSBC	Kauf	USD 2.698	Verkauf	NOK 26.400	153

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
20. März 2023	HSBC	Kauf	USD	1.381	Verkauf	NZD	2.210	\$ 15
20. März 2023	HSBC	Kauf	NOK	17.400	Verkauf	USD	1.683	-5
20. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	USD	505	Verkauf	NOK	5.200	3
20. März 2023	Morgan Stanley	Kauf	NOK	100.500	Verkauf	USD	10.358	-670
21. März 2023	Barclays	Kauf	USD	6.054	Verkauf	MYR	26.560	128
21. März 2023	Barclays	Kauf	MYR	3.160	Verkauf	USD	736	-31
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	7.496	Verkauf	SEK	78.300	-2
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	2.698	Verkauf	SEK	27.500	65
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	SEK	105.800	Verkauf	USD	10.249	-117
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	USD	5.143	Verkauf	BRL	26.650	100
20. Apr. 2023	HSBC	Kauf	PLN	4.300	Verkauf	USD	983	-20
25. Apr. 2023	Barclays	Kauf	USD	2.679	Verkauf	CAD	3.580	54
25. Apr. 2023	Citi	Kauf	CAD	8.340	Verkauf	USD	6.195	-79
25. Apr. 2023	HSBC	Kauf	CAD	1.590	Verkauf	USD	1.173	-7
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	5.992	Verkauf	COP	28.240.000	248
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	COP	10.400.000	Verkauf	USD	2.259	-144
28. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	18.989	Verkauf	MXN	364.400	-702
5. Mai 2023	HSBC	Kauf	EUR	1.260	Verkauf	USD	1.341	-3
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	24.240	Verkauf	USD	26.496	-756
8. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	5.130	Verkauf	CLP	4.310.000	-30
8. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	7.436	Verkauf	CLP	6.060.000	181
8. Mai 2023	HSBC	Kauf	CLP	10.370.000	Verkauf	USD	12.939	-524
12. Mai 2023	HSBC	Kauf	THB	81.800	Verkauf	USD	2.452	-120
15. Mai 2023	Barclays	Kauf	ZAR	5.600	Verkauf	USD	306	-3
15. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	7.737	Verkauf	ZAR	138.400	250
2. Juni 2023	HSBC	Kauf	GBP	920	Verkauf	USD	1.109	-
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	4.930	Verkauf	USD	5.950	-9
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.854 \$)							\$	1.448
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4.074 \$)								-4.239
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.220 \$)							\$	-2.791

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert			
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 17,87 % (28. Februar 2022: 15,72 %)			Kanada: 2,19 % (28. Februar 2022: 1,85 %)					
3.018	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class M1C, 144A, 8,317 %, fällig 25.10.2030 *	3.067	0,25	8.023	Air Canada 2020-2 Class A Pass Through Trust, 144A, 5,250 %, fällig 01.04.2029	7.713	0,64	
6.100	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class M2, 144A, 9,467 %, fällig 25.10.2030 *	6.344	0,52	5.590	Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027	4.628	0,38	
6.264	Bellemeade Re Ltd, Series 2021 2A, Class M1A, 144A, 5,684 %, fällig 25.06.2031 *	6.235	0,52	8.930	Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	8.079	0,67	
220	COMM 2017-PANW Mortgage Trust, Series 2017 PANW, Class D, 144A, 3,935 %, fällig 10.10.2029 *	201	0,02	6.600	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.042	0,50	
11.135	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 8,267 %, fällig 25.02.2040 *	11.262	0,93			26.462	2,19	
12.085	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 2M2, 144A, 8,267 %, fällig 25.02.2040 *	12.334	1,02	Chile: 0,99 % (28. Februar 2022: 0,54 %)				
295	Eagle RE 2021-1 Ltd, Series 2021 1, Class M1C, 144A, 7,184 %, fällig 25.10.2033 *	295	0,03	6.680	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	5.878	0,49	
200	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01, Class 1B1, 10,367 %, fällig 25.07.2029 *	221	0,02	6.729	Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26.11.2024	6.089	0,50	
7.602	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C02, Class 2M2C, 8,267 %, fällig 25.09.2029 *	7.932	0,65			11.967	0,99	
2.604	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 2M2, 7,417 %, fällig 25.02.2030 *	2.652	0,22	China: 1,27 % (28. Februar 2022: 0,59 %)				
21.338	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 01.09.2052	20.584	1,70	4.435	Alibaba Group Holding Ltd, 4,200 %, fällig 06.12.2047	3.465	0,29	
8.403	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA3, Series 2020 DNA3, Class B1, 144A, 9,717 %, fällig 25.06.2050 *	8.935	0,74	1.060	JD.com Inc, 3,375 %, fällig 14.01.2030	940	0,08	
2.731	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA4, Series 2020 HQA4, Class B1, 144A, 9,867 %, fällig 25.09.2050 *	2.885	0,24	705	NXP BV / NXP Funding LLC / NXP USA Inc, 3,400 %, fällig 01.05.2030	610	0,05	
3.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Series 2021 HQA2, Class B1, 144A, 7,634 %, fällig 25.12.2033 *	2.637	0,22	4.375	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,680 %, fällig 22.04.2041	3.287	0,27	
1.904	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class M2, 144A, 6,667 %, fällig 25.07.2049 *	1.905	0,16	2.395	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,240 %, fällig 03.06.2050	1.547	0,13	
5.935	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B1, 144A, 7,317 %, fällig 25.10.2049 *	5.965	0,49	740	Tencent Holdings Ltd, 144A, 3,840 %, fällig 22.04.2051	534	0,04	
579	Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Series 2019 HQA2, Class M2, 144A, 6,667 %, fällig 25.04.2049 *	580	0,05	340	Tencent Music Entertainment Group, 2,000 %, fällig 03.09.2030	259	0,02	
5.855	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 8,484 %, fällig 25.11.2050 *	5.912	0,49	5.735	Xiaomi Best Time International Ltd, 144A, 3,375 %, fällig 29.04.2030	4.685	0,39	
19.385	Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 6,784 %, fällig 25.08.2033 *	19.441	1,61			15.327	1,27	
11.780	Ginnie Mae II Pool 'MA8645', 4,000 %, fällig 20.02.2053	11.141	0,92	Kolumbien: 0,95 % (28. Februar 2022: 0,26 %)				
24.502	Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500 %, fällig 20.02.2053	23.788	1,96	3.715	Ecopetrol SA, 4,125 %, fällig 16.01.2025	3.558	0,29	
189	Home RE 2021-1 Ltd, Series 2021 1, Class M1B, 144A, 6,167 %, fällig 25.07.2033 *	189	0,02	3.100	Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	3.041	0,25	
571	Radnor RE 2021-1 Ltd, Series 2021 1, Class M1A, 144A, 6,134 %, fällig 27.12.2033 *	571	0,05	1.860	Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	1.228	0,10	
5.347	Radnor RE 2021-2 Ltd, Series 2021 2, Class M1A, 144A, 6,334 %, fällig 25.11.2031 *	5.349	0,44	4.420	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027	3.739	0,31	
5.000	Radnor RE 2021-2 Ltd, Series 2021 2, Class M1B, 144A, 8,184 %, fällig 25.11.2031 *	5.070	0,42			11.566	0,95	
3.232	STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 8,817 %, fällig 25.02.2047 *	3.319	0,27	Deutschland: 0,35 % (28. Februar 2022: 0,27 %)				
5.893	Towd Point Mortgage Trust 2017-6, Series 2017 6, Class B2, 144A, 3,236 %, fällig 25.10.2057 *	4.536	0,37	4.485	Siemens Financieringsmaatschappij NV, 144A, 0,650 %, fällig 11.03.2024	4.269	0,35	
17.590	Towd Point Mortgage Trust 2018-2, Series 2018 2, Class B1, 144A, 3,480 %, fällig 25.03.2058 *	14.379	1,19	Israel: 0,76 % (28. Februar 2022: 1,42 %)				
6.755	Towd Point Mortgage Trust 2018-3, Series 2018 3, Class B1, 144A, 3,740 %, fällig 25.05.2058 *	5.212	0,43	2.870	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	2.797	0,23	
9.125	Triangle Re 2021-3 Ltd, Series 2021 3, Class M1A, 144A, 6,384 %, fällig 25.02.2034 *	9.128	0,75	6.925	Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	6.432	0,53	
290	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-NXS5, Series 2016 NX55, Class C, 4,981 %, fällig 15.01.2059 *	252	0,02			9.229	0,76	
14.975	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Series 2014 LC14, Class D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047 *	13.934	1,15	Japan: 0,73 % (28. Februar 2022: 0,61 %)				
		216.255	17,87	9.715	Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	8.862	0,73	
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 226.724 \$)				Luxemburg: 0,79 % (28. Februar 2022: 0,74 %)				
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 58,40 % (28. Februar 2022: 56,53 %)				2.535	Alice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	2.076	0,17	
Australien: 0,40 % (28. Februar 2022: 0,32 %)				10.770	Alice France Holding SA, 144A, 6,000 %, fällig 15.02.2028	7.502	0,62	
AUD	730	NBN Co Ltd, 2,200 %, fällig 16.12.2030	388	0,03		9.578	0,79	
	5.430	NBN Co Ltd, 2,625 %, fällig 05.05.2031	4.417	0,37	Mexiko: 0,24 % (28. Februar 2022: 0,31 %)			
		4.805	0,40	3.770	Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	2.915	0,24	
Brasilien: 2,47 % (28. Februar 2022: 2,72 %)				Norwegen: 0,37 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
1.880	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028	1.641	0,13	1.410	Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2028	1.457	0,12	
4.900	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	4.066	0,34	2.915	Var Energi ASA, 144A, 8,000 %, fällig 15.11.2032	3.046	0,25	
4.710	Banco do Brasil SA/Cayman, 144A, 3,250 %, fällig 30.09.2026	4.291	0,35			4.503	0,37	
1.205	BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023	1.194	0,10	Panama: 0,29 % (28. Februar 2022: 0,21 %)				
1.335	Embraer Netherlands Finance BV, 144A, 6,950 %, fällig 17.01.2028	1.340	0,11	3.955	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	3.461	0,29	
6.645	Rumo Luxembourg Sarl, 144A, 4,200 %, fällig 18.01.2032	5.283	0,44	Südkorea: 0,39 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
13.775	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	12.100	1,00	4.995	SK Hynix Inc, 2,375 %, fällig 19.01.2031	3.698	0,31	
		29.915	2,47	1.000	SK Hynix Inc, 144A, 6,500 %, fällig 17.01.2033	985	0,08	
				4.683		4.683	0,39	
Supranational: 1,11 % (28. Februar 2022: 0,93 %)				Schweiz: 0,15 % (28. Februar 2022: 0,12 %)				
				8.685	Arab Petroleum Investments Corp, 1,483 %, fällig 06.10.2026	7.750	0,64	
MXN	61,000	International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	2.842	0,24	Vereinigtes Königreich: 1,17 % (28. Februar 2022: 0,84 %)			
BRL	17,100	International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	2.794	0,23	2.220	Ashtead Capital Inc, 144A, 5,500 %, fällig 11.08.2032	2.131	0,17
		4.805	0,40	5.610	HSBC Holdings Plc, 4,292 %, fällig 12.09.2026 *	5.403	0,45	
Schweiz: 0,15 % (28. Februar 2022: 0,12 %)				1.075	Nationwide Building Society, 5,750 %, Ewige Anleihe *	1.173	0,10	
				400	NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	397	0,03	
				3.625	NatWest Group Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	2.668	0,22	
				2.900	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.404	0,20	
						14.176	1,17	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert	
	USD	USD			USD	USD		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)								
USA: 42,28 % (28. Februar 2022: 43,77 %)								
3.665	Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	3.530	0,29	12.365	OWL Rock Core Income Corp, 3,125 %, fällig 23.09.2026	10.712	0,88	
5.100	Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	4.738	0,39	2.550	OWL Rock Core Income Corp, 144A, 7,750 %, fällig 16.09.2027	2.548	0,21	
7.208	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	7.006	0,58	4.040	Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.12.2025	3.688	0,30	
6.140	AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024	6.008	0,50	10.861	Owl Rock Technology Finance Corp, 144A, 3,750 %, fällig 17.06.2026	9.452	0,78	
2.021	Antero Resources Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.02.2029	2.038	0,17	5.345	Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2027	4.668	0,39	
5.515	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2026	5.024	0,41	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,300 %, fällig 15.02.2030	1.606	0,13	
435	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.08.2027	358	0,03	1.640	Regal Rexnord Corp, 144A, 6,400 %, fällig 15.04.2033	1.615	0,13	
9.530	Ares Capital Corp, 3,250 %, fällig 15.07.2025	8.871	0,73	4.430	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	3.646	0,30	
9.063	Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	7.814	0,65	890	Seagate HDD Cayman, 4,125 %, fällig 15.01.2031	739	0,06	
2.530	Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	2.080	0,17	12.350	Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15.10.2026	10.648	0,88	
3.890	AT&T Inc, 1,700 %, fällig 25.03.2026	3.497	0,29	12.250	Sprint Spectrum Co LLC / Sprint Spectrum Co II LLC / Sprint Spectrum Co III LLC, 144A, 5,152 %, fällig 20.03.2028	12.119	1,00	
11.500	AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	9.508	0,79	11.750	Stellantis Finance US Inc, 144A, 6,375 %, fällig 12.09.2032	12.025	0,99	
11.980	Athene Global Funding, 144A, 0,914 %, fällig 19.08.2024	11.082	0,92	1.220	Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	1.218	0,10	
9.925	Bain Capital Specialty Finance Inc, 2,950 %, fällig 10.03.2026	8.841	0,73	4.681	SVB Financial Group, 1,800 %, fällig 02.02.2031	3.479	0,29	
1.545	Blackstone Secured Lending Fund, 3,650 %, fällig 14.07.2023	1.533	0,13	4.065	Synchrony Financial, 7,250 %, fällig 02.02.2033	3.917	0,32	
2.280	Blackstone Secured Lending Fund, 3,625 %, fällig 15.01.2026	2.092	0,17	4.130	Syneos Health Inc, 144A, 3,625 %, fällig 15.01.2029	3.408	0,28	
9.170	Blackstone Secured Lending Fund, 2,125 %, fällig 15.02.2027	7.727	0,64	5.600	Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	5.916	0,49	
2.645	Blackstone Secured Lending Fund, 2,850 %, fällig 30.09.2028	2.138	0,18	3.530	TEGNA Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.03.2026	3.357	0,28	
4.645	Block Financial LLC, 3,875 %, fällig 15.08.2030	4.075	0,34	4.315	Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	4.234	0,35	
4.105	Broadcom Inc, 144A, 1,950 %, fällig 15.02.2028	3.481	0,29	12.860	Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, fällig 15.02.2025	13.118	1,08	
437	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	322	0,03	4.080	Univision Communications Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.06.2027	3.878	0,32	
353	Broadcom Inc, 144A, 4,926 %, fällig 15.05.2037	307	0,03	14.235	Valero Energy Corp, 3,650 %, fällig 01.12.2051	10.110	0,84	
6.055	Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	4.801	0,40	7.940	Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	7.252	0,60	
7.540	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	7.361	0,61	7.500	Viking Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.05.2025	6.961	0,57	
551	CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, fällig 14.03.2027	547	0,04	3.820	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	4.064	0,34	
11.635	CommScope Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2028	9.177	0,76	1.070	Vista Outdoor Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	869	0,07	
6.860	Consolidated Communications Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2028	4.571	0,38	5.955	Vontier Corp, 1,800 %, fällig 01.04.2026	5.197	0,43	
8.000	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	7.499	0,62	5.240	Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	4.298	0,35	
1.560	Dell International LLC / EMC Corp, 6,020 %, fällig 15.06.2026	1.580	0,13	13.920	Vontier Corp, 2,950 %, fällig 01.04.2031	10.618	0,88	
4.597	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 20.10.2025	4.468	0,37	7.110	World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	5.528	0,46	
12.530	Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	11.570	0,96	12.480	Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	12.123	1,00	
195	DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028	156	0,01			511.694	42,28	
27.582	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	17.765	1,47	Sambia: 1,50 % (28. Februar 2022: 1,03 %)				
2.530	FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	2.129	0,18	3.541	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	3.511	0,29	
6.000	Freedom Mortgage Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2025	5.690	0,47	15.590	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	14.640	1,21	
8.115	FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig 12.10.2028	6.680	0,55			18.151	1,50	
6.820	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,673 %, fällig 08.03.2024 *	6.800	0,56	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 800.247 \$)				
3.545	Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	3.220	0,27			706.757	58,40	
9.560	Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	8.280	0,68	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 11,58 % (28. Februar 2022: 16,67 %)				
6.560	Golub Capital BDC Inc, 2,050 %, fällig 15.02.2027	5.479	0,45	Brasilien: 3,45 % (28. Februar 2022: 3,08 %)				
13.773	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	11.862	0,98	BRL	265,490	Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	41.738	3,45
2.695	Harsco Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	2.290	0,19	Kolumbien: 2,95 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
4.090	HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	4.064	0,34	COP	244,435,000	Kolumbianische TES, Series B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	35.719	2,95
5.060	HP Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2028	4.872	0,40	Deutschland: 1,69 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
11.040	Hyundai Capital America, 144A, 2,000 %, fällig 15.06.2028	9.202	0,76	EUR	23,260	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, fällig 15.08.2053	20.521	1,69
4.870	Intel Corp, 4,150 %, fällig 05.08.2032	4.490	0,37	Mexiko: 2,93 % (28. Februar 2022: 0,76 %)				
2.247	IRB Holding Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2025	2.243	0,19	MXN	742,900	Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	35.412	2,93
3.025	Jabil Inc, 1,700 %, fällig 15.04.2026	2.695	0,22	USA: 0,56 % (28. Februar 2022: 12,04 %)				
6.580	Level 3 Financing Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.07.2029	4.145	0,34		9.520	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	6.791	0,56
1.025	Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	420	0,03	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 152.725 \$)				
12.100	Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	10.597	0,88	Schuldscheindarlehen: 0,43 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
6.945	MicroStrategy Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2028	5.773	0,48		5.250	Flutter Financing BV, 0,000 %, fällig 04.07.2028 *	5.258	0,43
12.713	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	12.725	1,05	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 5.139 \$)				
8.820	Mohegan Tribal Gaming Authority, 144A, 8,000 %, fällig 01.02.2026	8.271	0,68	Organismen für gemeinsame Anlagen: 7,05 % (28. Februar 2022: 2,53 %)				
19.660	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	18.457	1,52	85.354	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	85.354	7,05	
4.480	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	4.105	0,34	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 85.354 \$)				
3.830	Nexstar Media Inc, 144A, 4,750 %, fällig 01.11.2028	3.352	0,28	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.270.189 \$)				
1.705	Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	1.410	0,12	Credit Default Swaps: 0,11 % (28. Februar 2022: 1,41 %)				
3.255	Nordstrom Inc, 2,300 %, fällig 08.04.2024	3.079	0,25	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
1.160	Owl Rock Capital Corp, 4,000 %, fällig 30.03.2025	1.101	0,09	1.309				
4.330	Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	3.687	0,30	Devisenterminkontrakte: 0,29 % (28. Februar 2022: 0,57 %)				
				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
				3.510				
				Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
				1.158.624				
				Credit Default Swaps: (0,07 %) (28. Februar 2022: 0,00 %)				
				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
				(878)				
				(0,07)				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)		
Devisenterminkontrakte: -1,02 % (28. Februar 2022: -1,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-12.389	-1,02
Futures: (0,31 %) (28. Februar 2022: (0,08 %))		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-3.704	-0,31
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-16.971	-1,40
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	1.141.653	94,33
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	68.652	5,67
Gesamtvermögen		
	1.210.305 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 558.808.000 \$ und machten 46,17 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ABKÜRZUNGEN:

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

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

AUD – Australischer Dollar

BRL – Brasilianischer Real

COP – Kolumbianischer Peso

EUR – Euro

GBP – Britisches Pfund Sterling

MXN – Mexikanischer Peso

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	86,08
Andere übertragbare Wertpapiere, die auf einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	0,43
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,91
Finanzderivate	0,39
Sonstige Vermögenswerte	6,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2023	53.518	\$ 1.309
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2025	3.390	-3
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	– Verkauf	20. Juni 2026	15.700	-265
JP Morgan	Altice France S.A., 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-1
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2025	1.605	-192
JP Morgan	Altice Luxembourg S.A., 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2025	3.495	-417
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22.750 \$)					\$ 1.309
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					-878
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 22.750 \$)					\$ 431

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.292	Verkauf BRL 11.873	\$ 25
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 11.872	Verkauf USD 2.333	-66
7. März 2023	HSBC	Kauf USD 30.215	Verkauf AUD 43.950	633
7. März 2023	JP Morgan	Kauf USD 3.041	Verkauf AUD 4.530	-8
7. März 2023	JP Morgan	Kauf AUD 48.480	Verkauf USD 32.982	-351
14. März 2023	Barclays	Kauf USD 6.467	Verkauf JPY 880.000	-10
14. März 2023	HSBC	Kauf USD 24.685	Verkauf JPY 3.258.000	706
14. März 2023	HSBC	Kauf JPY 4.138.000	Verkauf USD 32.493	-2.038
14. März 2023	JP Morgan	Kauf USD 30.269	Verkauf JPY 3.955.000	1.160
14. März 2023	JP Morgan	Kauf JPY 3.955.000	Verkauf USD 30.190	-1.082
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 310	Verkauf AUD 454	5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 16	Verkauf CHF 15	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 28	Verkauf CNH 192	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 120	Verkauf EUR 114	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 14.826	Verkauf EUR 13.896	112
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.290	Verkauf GBP 1.065	10
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 3	Verkauf GBP 3	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 91	Verkauf SEK 953	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 91	Verkauf SGD 123	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.762	Verkauf SGD 3.692	23
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 422.239	Verkauf USD 453.823	-6.795
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 22.078	Verkauf USD 2.091	20
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 50	Verkauf USD 51	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 38.570	Verkauf USD 46.615	-207
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf GBP 1.260	Verkauf USD 1.512	4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 86.281	Verkauf USD 65.147	-1.136
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CZK 638	Verkauf USD 29	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SEK 4	Verkauf USD –	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CNH 6.221	Verkauf USD 917	-21
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf CHF 469	Verkauf USD 511	-12
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf AUD 7.473	Verkauf USD 5.196	-165
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf SGD 41	Verkauf USD 30	–
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 11.630	Verkauf USD 2.232	-25
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf USD 7.230	Verkauf BRL 37.460	140

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	BRL	22.500	Verkauf	USD	4.433	\$ -175
28. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	2.725	Verkauf	MXN	52.300	-101
5. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	30.689	Verkauf	EUR	28.270	671
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	6.320	Verkauf	USD	6.908	-197
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 9.078 \$)								\$ 3.510
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -17.153 \$)								-12.389
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -8.075 \$)								\$ -8.879

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Citi	-237	\$ -255.268	\$ -2.581
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Citi	2.201	297.272	-1.123
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): - \$)				\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.309 \$)				-3.704
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.309 \$)				\$ -3.704

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	Nettoinventarwert	% vom	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	Nettoinventarwert	% vom	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 81,49 % (28. Februar 2022: 56,32 %)				Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 4,43 % (28. Februar 2022: 7,89 %)				
915	Bellemeade Re 2020-2 Ltd, Series 2020 2A, Class M2, 144A, 10,617 %, fällig 26.08.2030 *	936	2,00	Brasilien: 1,90 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
440	Bellemeade Re 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class M2, 144A, 9,467 %, fällig 25.10.2030 *	457	0,98	BRL	5,660	Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2033	890	1,90
2.180	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC15, Series 2013 GC15, Class C, 5,170 %, fällig 10.09.2046 *	2.102	4,50	Kolumbien: 1,72 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
1.297	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2013-GC17, Series 2013 GC17, Class C, 5,110 %, fällig 10.11.2046 *	1.255	2,68	COP	7,080,000	Kolumbianische TES, Series B, 7,250 %, fällig 26.10.2050	802	1,72
460	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2014-GC23, Series 2014 GC23, Class D, 144A, 4,480 %, fällig 10.07.2047 *	406	0,87	USA: 0,81 % (28. Februar 2022: 5,24 %)				
745	COMM 2014-CCRE18 Mortgage Trust, Series 2014 CR18, Class AM, 4,103 %, fällig 15.07.2047	721	1,54	380	United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 2,046 %, fällig 30.04.2024 *	379	0,81	
982	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2B1, 144A, 9,867 %, fällig 25.06.2039 *	1.010	2,16	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.287 \$)				
1.448	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 8,717 %, fällig 25.07.2039 *	1.487	3,18	2.071		2.071	4,43	
1.180	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Series 2019 R06, Class 2B1, 144A, 8,367 %, fällig 25.09.2039 *	1.179	2,52	Organismen für gemeinsame Anlagen: 4,74 % (28. Februar 2022: 3,67 %)				
1.180	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 8,017 %, fällig 25.10.2039 *	1.173	2,51	2.216	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	2.216	4,74	
570	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,867 %, fällig 25.01.2040 *	557	1,19	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.216 \$)				
982	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C07, Class 2M2, 8,967 %, fällig 25.05.2029 *	1.027	2,20	Stammaktien: 0,05 % (28. Februar 2022: 0,06 %)				
590	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C01, Class 1B1, 10,367 %, fällig 25.07.2029 *	653	1,40	USA: 0,05 % (28. Februar 2022: 0,06 %)				
430	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 1B1, 8,767 %, fällig 25.02.2030 *	453	0,97	8	Danimer Scientific Inc	22	0,05	
1.300	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1B1, 8,167 %, fällig 25.07.2030 *	1.357	2,90	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 534 \$)				
1.635	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C01, Class 1M2, 6,867 %, fällig 25.07.2030 *	1.655	3,54	22		22	0,05	
1.415	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C03, Class 1B1, 8,367 %, fällig 25.10.2030 *	1.489	3,19	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 47.103 \$)				
795	Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 01.09.2052	767	1,64	45.793		45.793	97,94	
1.501	Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.501	3,21	Devisenterminkontrakte: 0,86 % (28. Februar 2022: 0,15 %)				
1.508	Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, fällig 01.12.2052	1.528	3,27	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
891	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig 01.09.2052	860	1,84	403		403	0,86	
1.496	Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, fällig 01.12.2052	1.516	3,24	Futures: 0,15 % (28. Februar 2022: 0,16 %)				
1.143	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Series 2020 DNA4, Class B1, 144A, 10,617 %, fällig 25.08.2050 *	1.241	2,65	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
1.900	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class M2, 144A, 6,584 %, fällig 25.10.2033 *	1.890	4,04	69		69	0,15	
1.849	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M1, 144A, 5,334 %, fällig 25.11.2041 *	1.820	3,89	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
EUR	1.746 GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Class A2, 2,233 %, fällig 21.06.2046 *	1.588	3,40	46.265		46.265	98,95	
30.094	GS Mortgage Securities Trust 2017-GS5, Series 2017 GS5, Class XA, 0,827 %, fällig 10.03.2050 *	795	1,70	Credit Default Swaps: -0,08 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				
EUR	600 IM Pastor 3 FTH 3, Class B, 2,371 %, fällig 22.03.2043 *	352	0,75	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
920	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class C, 4,145 %, fällig 15.10.2048 *	846	1,81	-37		-37	-0,08	
EUR	932 Landmark Mortgage Securities No 2 Plc 2, Class BC, 2,662 %, fällig 17.06.2039 *	862	1,84	Devisenterminkontrakte: -0,81 % (28. Februar 2022: -0,28 %)				
1.832	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2014-C14, Series 2014 C14, Class A5, 4,064 %, fällig 15.02.2047	1.806	3,86	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
442	STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class M2A, 144A, 6,717 %, fällig 25.09.2048 *	445	0,95	-175		-175	-0,38	
1.015	STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 8,817 %, fällig 25.02.2047 *	1.043	2,23	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten				
645	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,083 %, fällig 15.05.2048 *	543	1,16	-591		-591	-1,27	
50.611	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-LC22, Series 2015 LC22, Class XA, 0,756 %, fällig 15.09.2058 *	783	1,68	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 38.466 \$)				45.674		45.674	97,68	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 7,23 % (28. Februar 2022: 11,46 %)				Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				
Japan: 0,45 % (28. Februar 2022: 0,92 %)				1.082		1.082	2,32	
230	Nissan Motor Co Ltd, 4,345 %, fällig 17.09.2027	210	0,45	Gesamtnettovermögen				
USA: 6,78 % (28. Februar 2022: 9,05 %)				46.756 \$		46.756 \$	100,00	
270	Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	241	0,51	– 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 %.				
720	Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	708	1,51	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 16.372.000 \$ und machten 35,00 % des Nettovermögens aus.				
250	Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	234	0,50	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.				
325	DISH Network Corp, 3,375 %, fällig 15.08.2026	209	0,45	ABKÜRZUNGEN:				
530	Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	453	0,97	REMIC	–	Real Estate Mortgage Investment Conduit		
795	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2026	762	1,63	BRL	–	Brasilianischer Real		
530	Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	564	1,21	COP	–	Kolumbianischer Peso		
				EUR	–	Euro		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 3.600 \$)				Verteilung des Gesamtvermögens				
3.381		7,23		% des Gesamtvermögens				
				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				
				Organismen für gemeinsame Anlagen				
				Finanzderivate				
				Sonstige Vermögenswerte				
				Gesamtvermögen				
				100,00				

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 %	Kauf	20. Dez. 2027	2.350	\$ (37)
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 154 \$)					\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)					\$ (37)
Nettowertminderung von Credit Default Swaps (28. Februar 2022 (in Tsd.): 154 \$)					\$ (37)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
3. März 2023	Goldman Sachs	Kauf GBP	Verkauf USD 1.221	\$ -6	
3. März 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.383	Verkauf GBP 1.980	1	
3. März 2023	JP Morgan	Kauf GBP 970	Verkauf USD 1.168	-2	
7. März 2023	Citi	Kauf USD 977	Verkauf AUD 1.420	21	
7. März 2023	JP Morgan	Kauf AUD 1.420	Verkauf USD 966	-10	
8. März 2023	Citi	Kauf USD 991	Verkauf KRW 1.260.000	38	
8. März 2023	Citi	Kauf KRW 1.260.000	Verkauf USD 969	-16	
10. März 2023	HSBC	Kauf USD 990	Verkauf THB 33.900	30	
10. März 2023	HSBC	Kauf THB 33.900	Verkauf USD 983	-22	
14. März 2023	Barclays	Kauf USD 2.483	Verkauf JPY 326.000	83	
14. März 2023	Citi	Kauf USD 1.393	Verkauf JPY 186.000	24	
14. März 2023	Citi	Kauf USD 1.455	Verkauf JPY 198.000	-2	
14. März 2023	Goldman Sachs	Kauf JPY 249.000	Verkauf USD 1.956	-123	
14. März 2023	JP Morgan	Kauf USD 3.222	Verkauf JPY 430.000	57	
14. März 2023	JP Morgan	Kauf JPY 565.000	Verkauf USD 4.248	-90	
14. März 2023	UBS	Kauf JPY 326.000	Verkauf USD 2.408	-9	
20. März 2023	Goldman Sachs	Kauf NZD 1.500	Verkauf USD 959	-31	
20. März 2023	UBS	Kauf USD 942	Verkauf NZD 1.500	15	
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 1.890	Verkauf IDR 28.630.000	15	
18. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf IDR 28.630.000	Verkauf USD 1.902	-27	
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf USD 893	Verkauf BRL 4.700	4	
25. Apr. 2023	Citi	Kauf CAD 1.280	Verkauf USD 951	-12	
25. Apr. 2023	HSBC	Kauf USD 952	Verkauf CAD 1.280	13	
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 421	Verkauf COP 2.070.000	–	
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf USD 471	Verkauf COP 2.300.000	4	
28. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 477	Verkauf MXN 9.300	-26	
28. Apr. 2023	Morgan Stanley	Kauf MXN 9.300	Verkauf USD 480	22	
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 942	Verkauf EUR 890	-3	
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf USD 2.525	Verkauf EUR 2.310	72	
5. Mai 2023	Morgan Stanley	Kauf USD 183	Verkauf EUR 170	2	
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf USD 1.171	Verkauf GBP 970	2	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 79 \$)					\$ 403
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -145 \$)					-379
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -66 \$)					\$ 24

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
E-Mini Nasdaq 100 Index März 2023	Citi	-5	\$ -1.207	\$ -14	
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Citi	-8	-1.136	17	
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Citi	-5	-5.386	-74	
Russell 2000 Index März 2023	Citi	-27	-2.564	-87	
S&P 500 Index März 2023	Citi	-13	-2.584	34	
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2023	Citi	-55	-5.888	18	
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 86 \$)					\$ 69
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -81 \$)					-175
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 5 \$)					\$ -106

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 96,27 % (28. Februar 2022: 88,64 %)					
Australien: 0,71 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
70 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	59	0,71	40 PRA Group Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2025	40	0,48
Brasilien: 2,26 % (28. Februar 2022: 5,68 %)			85 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	72	0,86
245 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	189	2,26	145 ROCC Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	153	1,83
Kanada: 3,03 % (28. Februar 2022: 2,28 %)			45 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	41	0,48
170 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	154	1,83	45 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	45	0,53
110 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	101	1,20	25 Speedway Motorsports LLC / Speedway Funding II Inc, 144A, 4,875 %, fällig 01.11.2027	23	0,28
	255	3,03	20 Standard Industries Inc/NJ, 144A, 4,375 %, fällig 15.07.2030	17	0,20
China: 2,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			90 Texas Capital Bancshares Inc, 4,000 %, fällig 06.05.2031 *	81	0,96
200 Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032	195	2,32	275 TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026	272	3,24
Israel: 7,10 % (28. Februar 2022: 4,56 %)			65 Travel + Leisure Co, 144A, 4,500 %, fällig 01.12.2029	55	0,65
95 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,500 %, fällig 30.03.2024	93	1,10	55 Travel + Leisure Co, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2030	46	0,55
95 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	86	1,02	215 Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2026	195	2,32
40 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 30.06.2027	38	0,46	360 Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	364	4,34
140 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	131	1,57	35 United States Cellular Corp, 6,700 %, fällig 15.12.2033	32	0,38
250 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig 21.07.2023	247	2,95	75 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	66	0,79
	595	7,10	170 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	141	1,68
Italien: 1,15 % (28. Februar 2022: 1,08 %)			265 Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029	228	2,72
EUR 100 Verde Bidco SpA, 4,625 %, fällig 01.10.2026	97	1,15	105 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	96	1,14
Mexiko: 1,84 % (28. Februar 2022: 5,70 %)			30 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	27	0,32
200 Braskem Idesa SAPI, 144A, 7,450 %, fällig 15.11.2029	155	1,84	30 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, fällig 15.06.2031 *	26	0,31
Vereinigtes Königreich: 2,13 % (28. Februar 2022: 3,48 %)			75 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	71	0,85
36 British Airways 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, fällig 15.12.2032	31	0,36	80 Wynn Las Vegas LLC / Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	78	0,93
160 Connect Finco SARM / Connect US Finco LLC, 6,750 %, fällig 01.10.2026	148	1,77		6.155	73,37
	179	2,13	Sambia: 2,36 % (28. Februar 2022: 2,09 %)		
USA: 73,37 % (28. Februar 2022: 50,72 %)			200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 01.03.2024	198	2,36
245 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	219	2,61	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.336 \$)		
105 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	103	1,23	8.077 96,27		
230 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	177	2,11	Organismen für gemeinsame Anlagen: 4,90 % (28. Februar 2022: 8,68 %)		
245 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	194	2,32	411 Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	411	4,90
345 Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2028	302	3,60	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 411 \$)		
65 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	61	0,72	411 4,90		
200 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	173	2,06	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 8.747 \$)		
125 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, fällig 01.08.2028	106	1,26	8.488 101,17		
20 Cimarex Energy Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	17	0,21	Devisenterminkontrakte: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
120 Cimarex Energy Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	105	1,25	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) – –		
50 Civitas Resources Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2026	46	0,55	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
100 Cobra AcquisitionCo LLC, 144A, 6,375 %, fällig 01.11.2029	64	0,76	8.488 101,17		
145 Credit Acceptance Corp, 144A, 5,125 %, fällig 31.12.2024	136	1,62	Devisenterminkontrakte: -2,29 % (28. Februar 2022: -1,93 %)		
105 Credit Acceptance Corp, 6,625 %, fällig 15.03.2026	98	1,17	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -192 -2,29		
45 FirstCash Inc, 144A, 4,625 %, fällig 01.09.2028	39	0,47	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
100 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	89	1,06	-192 -2,29		
50 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	43	0,51	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
260 Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	222	2,65	8.296 98,88		
155 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	126	1,51	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
115 Home BancShares Inc/AR, 3,125 %, fällig 30.01.2032 *	95	1,13	93 1,12		
225 Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.08.2027	229	2,73	Gesamtvermögen		
35 Hyundai Capital America, 144A, 2,100 %, fällig 15.09.2028	29	0,35	8.389 \$ 100,00		
200 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	185	2,21			
200 Liberty Interactive LLC, 8,250 %, fällig 01.02.2030	82	0,98			
185 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2026	177	2,11			
120 Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026	111	1,32			
75 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025	70	0,84			
40 NFP Corp, 144A, 7,500 %, fällig 01.10.2030	38	0,45			
167 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,450 %, fällig 15.03.2023	167	1,99			
65 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 3,875 %, fällig 21.09.2023	64	0,77			
75 Parsley Energy LLC / Parsley Finance Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2028	69	0,82			
35 PDC Energy Inc, 6,125 %, fällig 15.09.2024	35	0,41			
135 PDC Energy Inc, 5,750 %, fällig 15.05.2026	129	1,54			
30 PennyMac Financial Services Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2031	24	0,28			
200 Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	162	1,93			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	181	Verkauf	GBP	150	\$	–
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	150	Verkauf	USD	181		–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	60	Verkauf	CAD	87		–
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	198	Verkauf	GBP	178		-4
10. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	6.095	Verkauf	USD	6.591		-140
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	EUR	1.540	Verkauf	USD	1.683		-48
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	170	Verkauf	USD	205		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): – \$)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -196 \$)									-192
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -196 \$)								\$	-192

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 13,31 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen: 5,60 % (28. Februar 2022: 4,07 %)		
1.600 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.543	2,22	30 Franklin Templeton Global Funds Plc – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund – Klasse LM USD thesaurierend	3.886	5,60
496 Fannie Mae Pool 'MA4785', 5,000 %, fällig 01.10.2052	488	0,70	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.500 \$)	3.886	5,60
1.182 Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig 01.12.2052	1.163	1,67	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 76.433 \$)	69.694	100,41
1.344 Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.344	1,94	Devisenterminkontrakte: 0,36 % (28. Februar 2022: 3,38 %)		
498 Freddie Mac Pool 'RA7790', 5,000 %, fällig 01.08.2052	490	0,71	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	249	0,36
1.056 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig 01.09.2052	1.019	1,47	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	69.943	100,77
749 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig 01.10.2052	723	1,04	Devisenterminkontrakte: -5,02 % (28. Februar 2022: -4,37 %)		
606 Freddie Mac Pool 'SD8267', 5,000 %, fällig 01.11.2052	597	0,86	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-3.482	-5,02
1.873 Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig 01.12.2052	1.872	2,70	Futures: -0,41 % (28. Februar 2022: -1,37 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-283	-0,41
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 9.207 \$)	9.239	13,31	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-3.765	-5,43
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 7,90 % (28. Februar 2022: 16,70 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Australien: 4,12 % (28. Februar 2022: 3,75 %)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
1.470 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, fällig 14.03.2025 *	1.477	2,13		3.232	4,66
1.370 Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024	1.383	1,99	Gesamtnettvermögen	69.410 \$	100,00
	2.860	4,12			
USA: 3,78 % (28. Februar 2022: 8,20 %)					
1.270 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig 01.11.2024	1.278	1,84			
1.340 Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, fällig 28.06.2024 *	1.347	1,94			
	2.625	3,78			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.446 \$)					
	5.485	7,90			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 73,60 % (28. Februar 2022: 76,03 %)					
Brasilien: 11,00 % (28. Februar 2022: 10,36 %)					
BRL 25,840 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2029	4.319	6,22			
BRL 20,530 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTNF, 10,000 %, fällig 01.01.2031	3.319	4,78			
	7.638	11,00			
Kolumbien: 7,24 % (28. Februar 2022: 3,21 %)					
COP 12,000,000 Kolumbianische TES, Series B, 6,000 %, fällig 28.04.2028	1.863	2,69			
COP 22,555,000 Kolumbianische TES, Series B, 7,000 %, fällig 30.06.2032	3.160	4,55			
	5.023	7,24			
Tschechische Republik: 4,84 % (28. Februar 2022: 4,86 %)					
CZK 97,300 Staatsanleihe der Tschechischen Republik, Series 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032	3.362	4,84			
Malaysia: 2,61 % (28. Februar 2022: 3,74 %)					
MYR 4,080 Malaysische Staatsanleihe, Series 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023	909	1,31			
MYR 930 Malaysische Staatsanleihe, Series 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	210	0,30			
MYR 3,070 Malaysische Staatsanleihe, Series 0417, 3,899 %, fällig 16.11.2027	691	1,00			
	1.810	2,61			
Mexiko: 20,07 % (28. Februar 2022: 17,20 %)					
MXN 39,500 Mexikanische Bonos, Series M 20, 8,500 %, fällig 31.05.2029	2.066	2,97			
MXN 39,100 Mexikanische Bonos, Series M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038	1.996	2,88			
MXN 168,300 Mexikanische Bonos, Series M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	7.892	11,37			
MXN 41,300 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	1.980	2,85			
	13.934	20,07			
Südafrika: 8,58 % (28. Februar 2022: 9,44 %)					
ZAR 33,800 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1.160	1,67			
ZAR 112,800 Staatsanleihe der südafrikanischen Regierung, Series 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048	4.793	6,91			
	5.953	8,58			
Südkorea: 6,52 % (28. Februar 2022: 6,92 %)					
KRW 5,130,000 Koreanische Schatzanleihe, Series 3106, 2,000 %, fällig 10.06.2031	3.403	4,90			
KRW 2,090,000 Koreanische Schatzanleihe, Series 5103, 1,875 %, fällig 10.03.2051	1.122	1,62			
	4.525	6,52			
USA: 12,74 % (28. Februar 2022: 9,65 %)					
7.560 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 3,334 %, fällig 31.07.2024 *	7.558	10,89			
1.280 United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,936 %, fällig 31.01.2025 *	1.281	1,85			
	8.839	12,74			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 58.280 \$)					
	51.084	73,60			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)		
3. März 2023	Barclays	Kauf	GBP	5.820	Verkauf	USD	7.166	\$ -165
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	USD	7.010	Verkauf	GBP	5.820	9
7. März 2023	HSBC	Kauf	AUD	170	Verkauf	USD	117	-2
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	AUD	2.390	Verkauf	USD	1.626	-17
8. März 2023	Citi	Kauf	USD	2.277	Verkauf	KRW	2.950.000	46
10. März 2023	HSBC	Kauf	THB	85.200	Verkauf	USD	2.472	-59
14. März 2023	Barclays	Kauf	JPY	33.000	Verkauf	USD	258	-15
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	JPY	1.934.000	Verkauf	USD	14.351	-117
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2.269	Verkauf	AUD	3.318	35
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	GBP	-	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	SGD	3	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	106.876	Verkauf	USD	74.323	-2.364
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	3	Verkauf	USD	4	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	101	Verkauf	USD	76	-1
20. März 2023	HSBC	Kauf	NZD	6.890	Verkauf	USD	4.309	-48
20. März 2023	HSBC	Kauf	NOK	34.500	Verkauf	USD	3.541	-216
21. März 2023	Barclays	Kauf	MYR	600	Verkauf	USD	140	-6
14. Apr. 2023	Citi	Kauf	USD	7.140	Verkauf	SEK	74.200	34
14. Apr. 2023	Citi	Kauf	SEK	1.300	Verkauf	USD	126	-2
14. Apr. 2023	HSBC	Kauf	SEK	72.900	Verkauf	USD	7.062	-81
25. Apr. 2023	Citi	Kauf	CAD	10.050	Verkauf	USD	7.465	-95
27. Apr. 2023	JP Morgan	Kauf	USD	1.861	Verkauf	COP	8.770.000	77
8. Mai 2023	HSBC	Kauf	CLP	5.610.000	Verkauf	USD	7.000	-284
15. Mai 2023	HSBC	Kauf	USD	576	Verkauf	ZAR	10.300	19
18. Mai 2023	Barclays	Kauf	USD	3.390	Verkauf	CZK	75.000	29
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	GBP	5.820	Verkauf	USD	7.024	-10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.520 \$)							\$	249
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4.556 \$)								-3.482
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.036 \$)							\$	-3.233

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-BTP März 2023	Morgan Stanley	54	\$ 6.436
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.151 \$)			\$ -
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.426 \$)			-283
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -275 \$)			\$ -283

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere: 18,58 %			Bergbau: 3,46 %		
600 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1M2, 144A, 6,384 %, fällig 25.12.2041 *	586	3,96	220 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	207	1,39
248 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M1, 144A, 6,484 %, fällig 25.03.2042 *	249	1,69	175 FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031	148	1,00
339 Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 01.09.2052	327	2,21	175 Taseko Mines Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2026	158	1,07
242 Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig 01.09.2052	234	1,58		513	3,46
165 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig 01.10.2052	160	1,08	Multinational: 3,87 %		
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M2, 144A, 6,284 %, fällig 25.11.2041 *	575	3,88	220 Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, fällig 06.10.2026	196	1,33
600 Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2022 HQA2, Class M1B, 144A, 8,484 %, fällig 25.07.2042 *	619	4,18	MXN 4,040 International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026	188	1,27
			BRL 1,150 International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026	188	1,27
				572	3,87
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.691 \$)	2.750	18,58	Öl u. Gas: 8,11 %		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 59,55 %			150 Aethon United BR LP / Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026	145	0,98
Fluggesellschaften: 1,76 %			150 CNX Resources Corp, 144A, 7,250 %, fällig 14.03.2027	149	1,01
129 Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027	125	0,85	155 Ecopetrol SA, 4,125 %, fällig 16.01.2025	148	1,00
135 Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 20.06.2027	135	0,91	120 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 4,875 %, fällig 30.03.2026	111	0,75
	260	1,76	140 Occidental Petroleum Corp, 6,125 %, fällig 01.01.2031	141	0,95
Automobilhersteller: 4,84 %			140 Talos Production Inc, 12,000 %, fällig 15.01.2026	148	1,00
190 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	181	1,22	165 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	151	1,02
185 Nissan Motor Acceptance Co LLC, 144A, 2,750 %, fällig 09.03.2028	153	1,03	200 Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2028	207	1,40
200 Stellantis NV, 5,250 %, fällig 15.04.2023	200	1,35		1.200	8,11
EUR 195 Volvo Car AB, 2,500 %, fällig 07.10.2027	183	1,24	Verpackung u. Behälter: 2,04 %		
	717	4,84	90 Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	78	0,52
Banken: 7,54 %			85 Pactiv Evergreen Group Issuer Inc/Pactiv Evergreen Group Issuer LLC, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2027	74	0,50
155 Bank of America Corp, 2,456 %, fällig 22.10.2025 *	147	0,99	175 Sealed Air Corp, 144A, 1,573 %, fällig 15.10.2026	151	1,02
EUR 200 BNP Paribas SA, 0,375 %, fällig 14.10.2027 *	184	1,24		303	2,04
220 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026 *	200	1,35	Pipelines: 1,98 %		
200 JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, fällig 09.08.2025 *	186	1,26	190 Cheniere Corpus Christi Holdings LLC, 2,742 %, fällig 31.12.2039	151	1,02
200 NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024 *	198	1,34	155 New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	142	0,96
215 UBS AG/London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024	201	1,36		293	1,98
	1.116	7,54	REITs: 1,03 %		
Computer: 1,01 %			150 Uniti Group LP / Uniti Fiber Holdings Inc / CSL Capital LLC, 144A, 7,875 %, fällig 15.02.2025	153	1,03
155 HP Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2028	149	1,01	Halbleiter: 1,21 %		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 3,70 %			235 Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032	178	1,21
160 Air Lease Corp, 0,800 %, fällig 18.08.2024	149	1,00	Telekommunikation: 2,32 %		
260 World Acceptance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.11.2026	202	1,37	180 AT&T Inc, 2,750 %, fällig 01.06.2031	149	1,01
225 XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026	197	1,33	215 Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig 26.11.2024	194	1,31
	548	3,70		343	2,32
Elektrik: 1,42 %			Transport: 1,25 %		
240 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	210	1,42	EUR 220 FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029	185	1,25
Elektronik: 2,06 %			Wasser: 1,00 %		
170 Jabil Inc, 3,600 %, fällig 15.01.2030	150	1,01	150 Solaris Midstream Holdings LLC, 144A, 7,625 %, fällig 01.04.2026	148	1,00
190 Vontier Corp, 2,400 %, fällig 01.04.2028	156	1,05	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.882 \$)		
	306	2,06		8.816	59,55
Energie – Alternative Quellen: 1,17 %			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 10,56 %		
EUR 205 Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, fällig 15.06.2034	173	1,17	Staatliche Papiere: 10,56 %		
Hoch- und Tiefbau u. Bauwesen: 0,75 %			BRL 640 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2031	104	0,70
120 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2026	112	0,75	BRL 2,560 Brasilianische Notas do Tesouro Nacional Serie F, Series NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	403	2,72
Nahrungsmittel: 3,42 %			COP 2,990,000 Kolumbianische TES, Series B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	437	2,95
200 BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023	198	1,34	200 Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, fällig 18.01.2033	196	1,33
135 Co-Operative Group Ltd, 5,125 %, fällig 17.05.2024	160	1,08	MXN 8,900 Mexikanische Bonos, Series M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	424	2,86
155 JBS USA LUX SA / JBS USA Food Co / JBS USA Finance Inc, 144A, 5,125 %, fällig 01.02.2028	148	1,00		1.564	10,56
	506	3,42	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.601 \$)		
Gas: 0,99 %				1.564	10,56
150 AmeriGas Partners LP / AmeriGas Finance Corp, 5,625 %, fällig 20.05.2024	147	0,99	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 13.174 \$)		
Gesundheit – Dienstleistungen: 2,03 %				13.130	88,69
160 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2026	156	1,06	Credit Default Swaps: 0,22 %		
145 HCA Inc, 5,000 %, fällig 15.03.2024	144	0,97	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	300	2,03	Devisenterminkontrakte: 0,58 %		
Investmentgesellschaften: 2,59 %			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
135 Ares Capital Corp, 2,150 %, fällig 15.07.2026	117	0,79	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
130 Main Street Capital Corp, 3,000 %, fällig 14.07.2026	114	0,77	13.249		
180 Owl Rock Capital Corp, 2,625 %, fällig 15.01.2027	153	1,03	Devisenterminkontrakte: -0,43 %		
	384	2,59	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			Futures: -0,83 %		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
			-187		
			-1,26		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	13.062	88,23
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.742	11,77
Gesamtnettovermögen	14.804 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 6.070.000 \$ und machten 41,02 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,41
Finanzderivate	0,79
Sonstige Vermögenswerte	11,80
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzeinheit – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Citi	CDX.NA.HY, 5,000 %	– Verkauf	20. Dez. 2023	1.350	\$ 33
Nicht realisierte Wertsteigerung von Credit Default Swaps					\$ 33
Nicht realisierte Wertminderung von Credit Default Swaps					–
Nettowertsteigerung von Credit Default Swaps					\$ 33

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
3. März 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	\$ –
3. März 2023	UBS	Kauf	Verkauf	3
7. März 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	8
7. März 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	-4
14. März 2023	Barclays	Kauf	Verkauf	–
14. März 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	9
14. März 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	-24
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	14
14. März 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	-14
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	Verkauf	-2
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	7
19. Apr. 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	-7
28. Apr. 2023	Citi	Kauf	Verkauf	-6
5. Mai 2023	HSBC	Kauf	Verkauf	7
5. Mai 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	38
5. Mai 2023	UBS	Kauf	Verkauf	-7
2. Juni 2023	JP Morgan	Kauf	Verkauf	–
Nicht realisierte Wertsteigerung von Devisenterminkontrakten				\$ 86
Nicht realisierte Wertminderung von Devisenterminkontrakten				-64
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten				\$ 22

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2023	Citi	2	\$ 284
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2023	Citi	-3	-3.231
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2023	Citi	27	3.646
Nicht realisierte Wertsteigerung von Futures-Kontrakten			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung von Futures-Kontrakten			-123
Nettowertminderung von Futures-Kontrakten			\$ -123

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen: 4,11 % (28. Februar 2022: 4,24 %)			Gesundheit – Dienstleistungen: 4,51 % (28. Februar 2022: 9,44 %)		
41			– DaVita Inc	17	0,67
– Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutional Class	41	1,62	– Laboratory Corp of America Holdings	48	1,92
– iShares Russell 1000 Value ETF – ETF	63	2,49	– Quest Diagnostics Inc	49	1,92
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 105 \$)	104	4,11		114	4,51
Stammaktien: 97,85 % (28. Februar 2022: 98,48 %)			Bauunternehmen: 0,95 % (28. Februar 2022: 1,66 %)		
Werbung: 1,66 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– PulteGroup Inc	24	0,95
– Omnicom Group Inc	42	1,66	Wohnungseinrichtungen: 0,15 % (28. Februar 2022: 0,85 %)		
Bekleidung: 0,44 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– Leggett & Platt Inc	4	0,15
– Capri Holdings Ltd	3	0,14	Versicherungen: 16,01 % (28. Februar 2022: 8,03 %)		
– Tapestry Inc	8	0,30	1 Aflac Inc	64	2,54
	11	0,44	1 American International Group Inc	70	2,74
Banken: 5,61 % (28. Februar 2022: 22,10 %)			– Assurant Inc	4	0,17
– BOK Financial Corp	5	0,21	– Chubb Ltd	79	3,10
– Comerica Inc	14	0,54	– Equitable Holdings Inc	4	0,14
1 Fifth Third Bancorp	38	1,50	– Fidelity National Financial Inc	11	0,45
1 KeyCorp	20	0,80	– First American Financial Corp	5	0,20
1 Regions Financial Corp	32	1,25	– Hanover Insurance Group Inc/The	6	0,22
– Synovus Financial Corp	9	0,36	– Hartford Financial Services Group Inc/The	38	1,48
– Truist Financial Corp	20	0,81	– Old Republic International Corp	9	0,37
– UMB Financial Corp	4	0,14	– Principal Financial Group Inc	33	1,30
	142	5,61	– RLI Corp	4	0,16
Biotechnologie: 1,26 % (28. Februar 2022: 2,90 %)			– Travelers Cos Inc/The	65	2,57
– Amgen Inc	32	1,26	– Unum Group	11	0,44
Baumaterialien: 1,73 % (28. Februar 2022: 2,73 %)			– Voya Financial Inc	3	0,13
– Builders FirstSource Inc	31	1,21		406	16,01
– Fortune Brands Innovations Inc	8	0,31	Freizeit: 0,31 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– Louisiana-Pacific Corp	5	0,21	– Polaris Inc	8	0,31
	44	1,73	Maschinen – Bau u. Bergbau: 3,26 % (28. Februar 2022: 1,19 %)		
Chemie: 1,89 % (28. Februar 2022: 1,45 %)			– Caterpillar Inc	83	3,26
– Huntsman Corp	14	0,54	Maschinen – Diversifiziert: 0,22 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– LyondellBasell Industries NV	22	0,88	– Crane Holdings Co	6	0,22
– Mosaic Co/The	12	0,47	Medien: 1,59 % (28. Februar 2022: 2,20 %)		
	48	1,89	– Charter Communications Inc	4	0,17
Gewerbliche Dienstleistungen: 1,90 % (28. Februar 2022: 0,24 %)			– Nexstar Media Group Inc 'A'	21	0,81
– FleetCor Technologies Inc	18	0,70	– Walt Disney Co/The	15	0,61
– ManpowerGroup Inc	8	0,31		40	1,59
– Service Corp International/US	22	0,89	Bergbau: 1,40 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	48	1,90	– Southern Copper Corp	36	1,40
Computer: 0,25 % (28. Februar 2022: 2,37 %)			Fertigung sonstige: 2,97 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
– DXC Technology Co	6	0,25	1 3M Co	75	2,97
Kosmetik u. Körperpflege: 1,03 % (28. Februar 2022: 2,00 %)			Öl u. Gas: 4,99 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
– Procter & Gamble Co/The	26	1,03	– Chevron Corp	11	0,43
Distribution u. Großhandel: 1,43 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– ConocoPhillips	8	0,32
1 LKQ Corp	36	1,43	– Exxon Mobil Corp	13	0,52
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 7,16 % (28. Februar 2022: 5,87 %)			– Marathon Oil Corp	12	0,48
– Ameriprise Financial Inc	56	2,21	– Marathon Petroleum Corp	32	1,26
– Capital One Financial Corp	46	1,83	– Pioneer Natural Resources Co	50	1,98
– Credit Acceptance Corp	8	0,30		126	4,99
– Discover Financial Services	35	1,39	Pharma: 5,47 % (28. Februar 2022: 7,05 %)		
– Lazard Ltd 'A'	3	0,14	– Bristol-Myers Squibb Co	13	0,52
– OneMain Holdings Inc	4	0,14	– Cigna Group/The	45	1,78
– SLM Corp	4	0,17	– CVS Health Corp	11	0,43
1 Synchrony Financial	25	0,98	– Johnson & Johnson	36	1,40
	181	7,16	– Merck & Co Inc	13	0,51
Elektrik: 1,92 % (28. Februar 2022: 4,34 %)			1 Pfizer Inc	21	0,83
1 Exelon Corp	34	1,32		139	5,47
– NextEra Energy Inc	15	0,60	Private Equity: 0,79 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	49	1,92	– Blackstone Inc	20	0,79
Elektrische Komponenten u. Zubehör: 0,15 % (28. Februar 2022: 0,07 %)			Einzelhandel: 9,36 % (28. Februar 2022: 8,29 %)		
– Acuity Brands Inc	4	0,15	– Advance Auto Parts Inc	18	0,70
Elektronik: 0,39 % (28. Februar 2022: 1,42 %)			– Best Buy Co Inc	25	0,99
– Arrow Electronics Inc	10	0,39	– Dick's Sporting Goods Inc	16	0,65
Nahrungsmittel: 3,71 % (28. Februar 2022: 1,88 %)			– Murphy USA Inc	13	0,51
1 Kroger Co/The	56	2,21	– Penske Automotive Group Inc	23	0,89
– Mondelez International Inc	6	0,25	– Target Corp	45	1,77
1 Tyson Foods Inc 'A'	32	1,25	– Ultra Beauty Inc	52	2,07
	94	3,71	– Walmart Inc	26	1,02
Forsterzeugnisse u. Papier: 0,60 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– Williams-Sonoma Inc	19	0,76
– International Paper Co	15	0,60		237	9,36

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	Nettoinventarwert	% vom
Halbleiter: 2,53 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
– KLA Corp	56		2,20
– Teradyne Inc	8		0,33
	64		2,53
Telekommunikation: 5,19 % (28. Februar 2022: 1,47 %)			
2 Cisco Systems Inc	111		4,37
1 Corning Inc	20		0,82
	131		5,19
Transport: 7,02 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
– CH Robinson Worldwide Inc	14		0,57
1 CSX Corp	35		1,37
– FedEx Corp	44		1,73
– Union Pacific Corp	85		3,35
	178		7,02
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 2.395 \$)	2.479		97,85
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 2.500 \$)	2.583		101,96
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.583		101,96
Devisenterminkontrakte: -0,81 % (28. Februar 2022: -1,32 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-20		-0,81
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-20		-0,81
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	2.563		101,15
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	-29		-1,15
Gesamtneuvermögen	2.534 \$		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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,94
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,98
Sonstige Vermögenswerte	1,08
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.264
			Verkauf	USD
				1.358
				\$ -20
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1 \$)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -29 \$)				
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -28 \$)				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 99,17 % (28. Februar 2022: 96,99 %)			Bergbau: 5,43 % (28. Februar 2022: 2,86 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung: 1,64 % (28. Februar 2022: 1,43 %)			186 Alcoa Corp 9.090 0,98		
EUR 117 Airbus SE	15.257	1,64	625 Freeport-McMoRan Inc	25.628	2,76
Fluggesellschaften: 0,82 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			133 Royal Gold Inc	15.749	1,69
147 United Airlines Holdings Inc	7.614	0,82		50.467	5,43
Automobilhersteller: 0,80 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			Fertigung sonstige: 1,21 % (28. Februar 2022: 2,31 %)		
193 General Motors Co	7.485	0,80	EUR 73 Siemens AG	11.251	1,21
Banken: 10,33 % (28. Februar 2022: 12,59 %)			Öl u. Gas: 9,97 % (28. Februar 2022: 9,93 %)		
872 Bank of America Corp	29.878	3,21	336 APA Corp	12.896	1,39
49 Goldman Sachs Group Inc/The	17.151	1,85	710 EQT Corp	23.551	2,53
108 M&T Bank Corp	16.685	1,79	136 Hess Corp	18.277	1,96
82 Signature Bank/New York NY	9.416	1,01	480 Noble Corp Plc	19.988	2,15
491 Wells Fargo & Co	22.938	2,47	291 TotalEnergies SE ADR	18.025	1,94
	96.068	10,33		92.737	9,97
Getränke: 1,17 % (28. Februar 2022: 1,10 %)			Öl- u. Gasdienstleistungen 3,46 % (28. Februar 2022: 1,57 %)		
48 Constellation Brands Inc 'A'	10.847	1,17	611 Baker Hughes Co 'A'	18.678	2,01
Biotechnologie: 5,57 % (28. Februar 2022: 5,27 %)			254 Schlumberger Ltd	13.499	1,45
45 Biogen Inc	12.082	1,30		32.177	3,46
204 BioMarin Pharmaceutical Inc	20.310	2,19	Pharma: 4,16 % (28. Februar 2022: 3,33 %)		
55 BioNTech SE ADR	7.189	0,77	74 AbbVie Inc	11.447	1,23
42 Vertex Pharmaceuticals Inc	12.188	1,31	197 AstraZeneca Plc ADR	12.832	1,38
	51.769	5,57	172 CVS Health Corp	14.368	1,55
Chemie: 2,02 % (28. Februar 2022: 0,75 %)				38.647	4,16
EUR 51 Air Liquide SA	8.147	0,88	Pipelines: 1,90 % (28. Februar 2022: 2,08 %)		
199 Mosaic Co/The	10.594	1,14	471 Enbridge Inc	17.662	1,90
	18.741	2,02	Immobilien: 0,86 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
Kosmetik u. Körperpflege: 2,71 % (28. Februar 2022: 1,61 %)			97 Howard Hughes Corp/The	8.038	0,86
1.546 Coty Inc 'A'	17.449	1,88	Einzelhandel: 0,78 % (28. Februar 2022: 1,09 %)		
GBP 1.992 Haleon Plc	7.710	0,83	279 Bloomin' Brands Inc	7.290	0,78
	25.159	2,71	Halbleiter: 2,44 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Distribution u. Großhandel: 1,10 % (28. Februar 2022: 0,94 %)			247 Micron Technology Inc	14.295	1,54
JPY 799 Marubeni Corp	10.195	1,10	97 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	8.410	0,90
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 2,60 % (28. Februar 2022: 5,81 %)				22.705	2,44
145 Capital One Financial Corp	15.796	1,70	Software: 5,91 % (28. Februar 2022: 4,85 %)		
194 OneMain Holdings Inc	8.358	0,90	157 Black Knight Inc	9.344	1,00
	24.154	2,60	147 Fiserv Inc	16.925	1,82
Elektrik: 6,47 % (28. Februar 2022: 3,02 %)			292 Oracle Corp	25.492	2,74
792 AES Corp/The	19.541	2,10	29 VMware Inc	3.229	0,35
147 American Electric Power Co Inc	12.885	1,39		54.990	5,91
199 Constellation Energy Corp	14.905	1,60	Telekommunikation: 1,63 % (28. Februar 2022: 3,09 %)		
585 Vistra Corp	12.860	1,38	106 T-Mobile US Inc	15.116	1,63
	60.191	6,47	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 844.998 \$)		
Elektronik: 1,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				921.986	99,17
242 Sensata Technologies Holding Plc	12.252	1,32	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
Energie – Alternative Quellen: 1,79 % (28. Februar 2022: 1,74 %)			bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 844.998 \$)		
341 Fluence Energy Inc	6.361	0,68		921.986	99,17
32 SolarEdge Technologies Inc	10.301	1,11	Devisenterminkontrakte: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	16.662	1,79	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 10 –		
Gesundheit – Produkte: 1,96 % (28. Februar 2022: 3,40 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
147 Zimmer Biomet Holdings Inc	18.177	1,96	bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Gesundheit – Dienstleistungen: 2,09 % (28. Februar 2022: 2,15 %)				921.996	99,17
117 Tenet Healthcare Corp	6.857	0,74	Devisenterminkontrakte: -0,10 % (28. Februar 2022: -0,07 %)		
26 UnitedHealth Group Inc	12.546	1,35	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -976 -0,10		
	19.403	2,09	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
Holdinggesellschaften – Diversifiziert: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,32 %)			bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
142 East Resources Acquisition Co	25	–		-976	-0,10
Versicherungen: 7,60 % (28. Februar 2022: 6,77 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
489 American International Group Inc	29.832	3,21	bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
585 Equitable Holdings Inc	18.385	1,98		921.020	99,07
30 Everest Re Group Ltd	11.326	1,22	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
807 MGIC Investment Corp	11.095	1,19		8.706	0,93
	70.638	7,60	Gesamtneuvermögen		
Internet: 6,89 % (28. Februar 2022: 5,54 %)				929.726 \$	100,00
103 Expedia Group Inc	11.212	1,21	– 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 %.		
173 Meta Platforms Inc 'A'	30.245	3,25	ABKÜRZUNGEN:		
680 Uber Technologies Inc	22.618	2,43	ADR	–	American Depositary Receipt
	64.075	6,89	EUR	–	Euro
Lodging: 2,97 % (28. Februar 2022: 2,61 %)			GBP	–	Britisches Pfund Sterling
196 Las Vegas Sands Corp	11.244	1,21	JPY	–	Japanischer Yen
381 MGM Resorts International	16.382	1,76	Verteilung des Gesamtvermögens		
	27.626	2,97	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 98,03		
Maschinen – Diversifiziert: 1,57 % (28. Februar 2022: 1,08 %)			Finanzderivate –		
884 CNH Industrial NV	14.568	1,57	Sonstige Vermögenswerte 1,97		
			Gesamtvermögen		
			100,00		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	EUR	6	\$	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.001	Verkauf	EUR	938		9
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	11		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	SGD	8		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	59.107	Verkauf	USD	63.523		-947
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	287	Verkauf	USD	303		1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	2.387	Verkauf	USD	1.801		-29
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 14 \$)								\$	10
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -641 \$)									-976
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -627 \$)								\$	-966

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 93,97 % (28. Februar 2022: 95,93 %)			Medien: 1,98 % (28. Februar 2022: 2,92 %)		
Automobilhersteller: 0,44 % (28. Februar 2022: 0,60 %)			66 Comcast Corp 2.454 1,29		
22 General Motors Co	835	0,44	13 Walt Disney Co/The	1.308	0,69
Banken: 5,28 % (28. Februar 2022: 6,86 %)			3.762 1,98		
100 Bank of America Corp	3.423	1,81	Fertigung sonstige: 1,03 % (28. Februar 2022: 0,57 %)		
38 JPMorgan Chase & Co	5.384	2,84	11 Eaton Corp Plc 1.960 1,03		
25 US Bancorp	1.199	0,63	Öl u. Gas: 1,53 % (28. Februar 2022: 1,62 %)		
	10.006	5,28	14 Pioneer Natural Resources Co 2.897 1,53		
Getränke: 2,85 % (28. Februar 2022: 2,50 %)			Verpackung u. Behältnisse: 0,65 % (28. Februar 2022: 0,90 %)		
40 Coca-Cola Co/The	2.396	1,26	22 Ball Corp 1.231 0,65		
17 PepsiCo Inc	3.017	1,59	Pharma: 9,05 % (28. Februar 2022: 6,90 %)		
	5.413	2,85	4 AbbVie Inc 688 0,36		
Baumaterialien: 0,85 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			9 Becton Dickinson and Co 2.173 1,15		
9 Vulcan Materials Co	1.618	0,85	7 Eli Lilly & Co 2.137 1,13		
Chemie: 4,64 % (28. Februar 2022: 4,36 %)			29 Johnson & Johnson 4.461 2,35		
12 Air Products & Chemicals Inc	3.385	1,79	50 Merck & Co Inc 5.302 2,80		
9 Ecolab Inc	1.367	0,72	59 Pfizer Inc 2.393 1,26		
20 PPG Industries Inc	2.656	1,40	17.154 9,05		
6 Sherwin-Williams Co/The	1.387	0,73	Pipelines: 0,73 % (28. Februar 2022: 0,51 %)		
	8.795	4,64	81 Kinder Morgan Inc 1.384 0,73		
Gewerbliche Dienstleistungen: 2,23 % (28. Februar 2022: 1,69 %)			Einzelhandel: 5,87 % (28. Februar 2022: 4,29 %)		
17 Automatic Data Processing Inc	3.687	1,95	2 Costco Wholesale Corp 1.146 0,60		
7 PayPal Holdings Inc	534	0,28	11 Home Depot Inc/The 3.137 1,66		
	4.221	2,23	59 TJX Cos Inc/The 4.514 2,38		
Computer: 5,41 % (28. Februar 2022: 6,40 %)			16 Walmart Inc 2.329 1,23		
70 Apple Inc	10.257	5,41	11.126 5,87		
Kosmetik u. Körperpflege: 1,47 % (28. Februar 2022: 1,48 %)			Halbleiter: 1,79 % (28. Februar 2022: 1,45 %)		
20 Procter & Gamble Co/The	2.789	1,47	3 ASML Holding NV 1.725 0,91		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 4,58 % (28. Februar 2022: 4,04 %)			7 NVIDIA Corp 1.667 0,88		
9 CME Group Inc	1.759	0,93	3.392 1,79		
14 Intercontinental Exchange Inc	1.429	0,75	Software: 9,29 % (28. Februar 2022: 11,76 %)		
25 Visa Inc 'A'	5.506	2,90	6 Adobe Inc 2.088 1,10		
	8.694	4,58	52 Microsoft Corp 13.012 6,86		
Elektrik: 1,27 % (28. Februar 2022: 0,77 %)			29 Oracle Corp 2.514 1,33		
15 NextEra Energy Inc	1.046	0,55	17.614 9,29		
9 Sempra Energy	1.368	0,72	Telekommunikation: 2,55 % (28. Februar 2022: 3,33 %)		
	2.414	1,27	7 Arista Networks Inc 1.024 0,54		
Elektrische Komponenten u. Zubehör: 0,89 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			17 T-Mobile US Inc 2.385 1,26		
20 Emerson Electric Co	1.690	0,89	37 Verizon Communications Inc 1.434 0,75		
Elektronik: 2,46 % (28. Februar 2022: 2,16 %)			4.843 2,55		
24 Honeywell International Inc	4.660	2,46	Transport: 2,88 % (28. Februar 2022: 2,75 %)		
Energie – Alternative Quellen: 0,26 % (28. Februar 2022: 0,48 %)			18 Canadian Pacific Railway Ltd 1.352 0,72		
2 Enphase Energy Inc	493	0,26	4 Union Pacific Corp 895 0,47		
Umweltkontrolle: 1,68 % (28. Februar 2022: 1,43 %)			18 United Parcel Service Inc 'B' 3.207 1,69		
21 Waste Management Inc	3.179	1,68	5.454 2,88		
Nahrungsmittel: 1,29 % (28. Februar 2022: 0,99 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 140.839 \$) 178.185 93,97		
5 McCormick & Co Inc/MD	335	0,18	Real Estate Investment Trusts: 1,32 % (28. Februar 2022: 1,25 %)		
32 Mondelez International Inc	2.108	1,11	REITs: 1,32 % (28. Februar 2022: 1,25 %)		
	2.443	1,29	13 American Tower Corp 2.496 1,32		
Gesundheit – Produkte: 3,08 % (28. Februar 2022: 2,88 %)			Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.121 \$) 2.496 1,32		
7 Stryker Corp	1.817	0,96	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
7 Thermo Fisher Scientific Inc	4.023	2,12	bewerteten finanziellen Vermögenswerte 180.681 95,29		
	5.840	3,08	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
Gesundheit – Dienstleistungen: 3,11 % (28. Februar 2022: 2,83 %)			bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 180.681 95,29		
12 UnitedHealth Group Inc	5.899	3,11	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 8.929 4,71		
Versicherungen: 7,66 % (28. Februar 2022: 6,35 %)			Gesamtnettovermögen 189.610 \$ 100,00		
– Berkshire Hathaway Inc	6.474	3,41	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, beaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
13 Hartford Financial Services Group Inc/The	1.003	0,53	Verteilung des Gesamtvermögens		
17 Progressive Corp/The	2.455	1,30	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 95,09		
25 Travelers Cos Inc/The	4.590	2,42	Sonstige Vermögenswerte 4,91		
	14.522	7,66	Gesamtvermögen 100,00		
Internet: 5,69 % (28. Februar 2022: 10,60 %)					
28 Alphabet Inc	2.490	1,31			
32 Alphabet Inc 'A'	2.925	1,54			
47 Amazon.com Inc	4.446	2,35			
4 Meta Platforms Inc 'A'	700	0,37			
1 Palo Alto Networks Inc	235	0,12			
	10.796	5,69			
Eisen/Stahl: 1,09 % (28. Februar 2022: 0,99 %)					
68 ArcelorMittal SA	2.065	1,09			
Beherbergung: 0,39 % (28. Februar 2022: 0,16 %)					
4 Marriott International Inc/MD	739	0,39			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 94,00 % (28. Februar 2022: 97,57 %)			Einzelhandel: 1,08 % (28. Februar 2022: 4,67 %)		
Bekleidung: 2,34 % (28. Februar 2022: 1,68 %)			Halbleiter: 7,23 % (28. Februar 2022: 6,96 %)		
242 NIKE Inc	28.726	2,34	91 Advance Auto Parts Inc	13.250	1,08
Automobilhersteller: 0,78 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Software: 15,08 % (28. Februar 2022: 19,87 %)		
46 Tesla Inc	9.526	0,78	38 ASML Holding NV	23.680	1,93
Autoteile u. Ausstattung: 1,59 % (28. Februar 2022: 1,54 %)			347 Intel Corp	8.634	0,71
168 Aptiv Plc	19.492	1,59	242 NVIDIA Corp	56.270	4,59
Getränke: 2,54 % (28. Februar 2022: 1,63 %)				88.584	7,23
306 Monster Beverage Corp	31.089	2,54	Transport: 2,09 % (28. Februar 2022: 2,84 %)		
Chemie: 1,40 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			141 United Parcel Service Inc 'B'	25.643	2,09
78 Sherwin-Williams Co/The	17.190	1,40	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.007.153 \$)		
Gewerbliche Dienstleistungen: 4,38 % (28. Februar 2022: 3,83 %)				1.152.143	94,00
292 PayPal Holdings Inc	21.466	1,75	Real Estate Investment Trusts: 1,68 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
94 S&P Global Inc	32.228	2,63	REITs: 1,68 % (28. Februar 2022: 1,51 %)		
	53.694	4,38	30 Equinix Inc	20.644	1,68
Computer: 4,50 % (28. Februar 2022: 4,50 %)			Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 14.198 \$)		
374 Apple Inc	55.121	4,50		20.644	1,68
Kosmetik u. Körperpflege: 1,77 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.021.351 \$)		
89 Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	21.700	1,77		1.172.787	95,68
Distribution u. Großhandel: 2,87 % (28. Februar 2022: 2,08 %)			Devisenterminkontrakte: 0,02 % (28. Februar 2022: 0,26 %)		
53 WW Grainger Inc	35.181	2,87	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 5,87 % (28. Februar 2022: 4,64 %)				286	0,02
327 Visa Inc 'A'	71.892	5,87	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Elektrik: 0,97 % (28. Februar 2022: 0,00 %)				1.173.073	95,70
167 NextEra Energy Inc	11.886	0,97	Devisenterminkontrakte: -0,12 % (28. Februar 2022: -0,10 %)		
Elektronik: 2,13 % (28. Februar 2022: 1,97 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
136 Honeywell International Inc	26.106	2,13		-1.551	-0,12
Gesundheit – Produkte: 8,51 % (28. Februar 2022: 6,23 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
358 Alcon Inc	24.406	1,99		-1.551	-0,12
97 Intuitive Surgical Inc	22.179	1,81	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
92 Stryker Corp	24.102	1,97		1.171.522	95,58
62 Thermo Fisher Scientific Inc	33.647	2,74	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	104.334	8,51		54.213	4,42
Gesundheit – Dienstleistungen: 3,99 % (28. Februar 2022: 3,99 %)			Gesamtnettovermögen		
103 UnitedHealth Group Inc	48.925	3,99		1.225.735 \$	100,00
Versicherungen: 1,78 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			– 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 %.		
135 Marsh & McLennan Cos Inc	21.872	1,78	ABKÜRZUNGEN:		
Internet: 16,25 % (28. Februar 2022: 23,84 %)			ADR – American Depositary Receipt		
781 Amazon.com Inc	73.548	6,00	Verteilung des Gesamtvermögens		
176 Meta Platforms Inc 'A'	30.721	2,51	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
110 Netflix Inc	35.467	2,89			
164 Palo Alto Networks Inc	30.935	2,52			
139 Sea Ltd ADR	8.668	0,71			
598 Uber Technologies Inc	19.901	1,62			
	199.240	16,25			
Fertigung sonstige: 2,55 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
178 Eaton Corp Plc	31.219	2,55			
Pharma: 4,30 % (28. Februar 2022: 3,43 %)					
208 Dexcom Inc	23.117	1,89			
177 Zoetis Inc	29.530	2,41			
	52.647	4,30			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 25.581	Verkauf BRL 132.514	\$ 272
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 2.659	Verkauf BRL 14.000	-15
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 146.513	Verkauf USD 28.783	-798
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 1.382	Verkauf EUR 1.294	11
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf USD 11	Verkauf EUR 10	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 29.433	Verkauf USD 31.631	-471
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf EUR 16	Verkauf USD 17	–
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf USD 478	Verkauf BRL 2.500	3
04. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf BRL 122.438	Verkauf USD 23.492	-267
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 4.603 \$)				\$ 286
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.709 \$)				-1.551
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.894 \$)				\$ -1.265

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert	
Stammaktien: 95,22 % (28. Februar 2022: 99,69 %)			
Getränke: 1,70 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
22 Diageo Plc ADR	3.825		1,70
Biotechnologie: 14,46 % (28. Februar 2022: 14,56 %)			
28 Biogen Inc	7.588		3,37
40 Guardant Health Inc	1.235		0,55
123 Ionis Pharmaceuticals Inc	4.409		1,96
56 Ultragenyx Pharmaceutical Inc	2.486		1,11
58 Vertex Pharmaceuticals Inc	16.787		7,47
	32.505		14,46
Baumaterialien: 3,56 % (28. Februar 2022: 2,69 %)			
128 Johnson Controls International plc	7.995		3,56
Computer: 6,43 % (28. Februar 2022: 7,53 %)			
7 Accenture Plc 'A'	1.784		0,80
54 CrowdStrike Holdings Inc	6.480		2,88
74 Seagate Technology Holdings Plc	4.745		2,11
37 Western Digital Corp	1.433		0,64
	14.442		6,43
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 0,67 % (28. Februar 2022: 0,50 %)			
21 Cohen & Steers Inc	1.507		0,67
Elektronik: 6,57 % (28. Februar 2022: 6,74 %)			
116 TE Connectivity Ltd	14.779		6,57
Entertainment: 4,72 % (28. Februar 2022: 4,52 %)			
53 Madison Square Garden Entertainment Corp	3.195		1,42
39 Madison Square Garden Sports Corp	7.409		3,30
	10.604		4,72
Gesundheit – Produkte: 2,10 % (28. Februar 2022: 2,03 %)			
17 Insulet Corp	4.717		2,10
Gesundheit – Dienstleistungen: 9,41 % (28. Februar 2022: 8,72 %)			
21 Charles River Laboratories International Inc	4.684		2,08
35 UnitedHealth Group Inc	16.473		7,33
	21.157		9,41
Wohnungseinrichtungen: 1,46 % (28. Februar 2022: 1,41 %)			
40 Dolby Laboratories Inc 'A'	3.284		1,46
Internet: 5,83 % (28. Februar 2022: 10,96 %)			
32 Airbnb Inc	3.940		1,75
44 Etsy Inc	5.373		2,39
113 Lyft Inc	1.128		0,50
29 Match Group Inc	1.203		0,54
8 Meta Platforms Inc 'A'	1.453		0,65
	13.097		5,83
Medien: 10,44 % (28. Februar 2022: 17,93 %)			
38 AMC Networks Inc	842		0,37
271 Comcast Corp	10.084		4,48
32 Liberty Broadband Corp	2.802		1,25
16 Liberty Broadband Corp	1.411		0,63
74 Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	5.028		2,24
49 Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	1.591		0,71
110 Warner Bros Discovery Inc	1.710		0,76
	23.468		10,44
Bergbau: 1,49 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			
81 Freeport-McMoRan Inc	3.340		1,49
Pharma: 2,14 % (28. Februar 2022: 1,04 %)			
31 AbbVie Inc	4.818		2,14
Halbleiter: 11,40 % (28. Februar 2022: 11,73 %)			
30 Broadcom Inc	17.772		7,90
106 Wolfspeed Inc	7.861		3,50
	25.633		11,40
Software: 12,84 % (28. Februar 2022: 9,33 %)			
58 Autodesk Inc	11.555		5,14
40 DocuSign Inc 'A'	2.472		1,10
81 Doximity Inc	2.721		1,21
21 HubSpot Inc	8.114		3,61
26 Snowflake Inc	4.006		1,78
	28.868		12,84
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 169.098 \$)			
	214.039		95,22
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 169.098 \$)			
	214.039		95,22

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)		% vom Nettoinventarwert
	USD	Nettoinventarwert	
Devisenterminkontrakte: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,02 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			
	4		–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
	214.043		95,22
Devisenterminkontrakte: -0,10 % (28. Februar 2022: -0,02 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			
	-229		-0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
	-229		-0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
	213.814		95,12
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			
	10.979		4,88
Gesamnettovermögen			
	224.793 \$		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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,76
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	5,24
Gesamtvermögen	100,00

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	209	Verkauf	AUD	310	\$	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	AUD	5		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	CHF	2		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	45	Verkauf	CNH	314		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	170	Verkauf	CNH	1.159		4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	33	Verkauf	EUR	31		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	3	Verkauf	EUR	2		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	15	Verkauf	GBP	13		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	8		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	60	Verkauf	SGD	81		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	731	Verkauf	USD	786		-12
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	302	Verkauf	USD	364		-2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	USD	-		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	-		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	1.922	Verkauf	USD	1.451		-25
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CHF	47	Verkauf	USD	51		-1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	8.276	Verkauf	USD	1.221		-28
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	196	Verkauf	USD	19		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	7.259	Verkauf	USD	5.048		-161
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 113 \$)								\$	4
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -123 \$)									-229
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -10 \$)								\$	-225

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 78,26 % (28. Februar 2022: 74,41 %)			Private Equity: 1,83 % (28. Februar 2022: 1,72 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung: 2,40 % (28. Februar 2022: 1,75 %)			Halbleiter: 7,20 % (28. Februar 2022: 6,30 %)		
1 L3Harris Technologies Inc	199	0,52	8 Blackstone Inc	705	1,83
7 Raytheon Technologies Corp	725	1,88	– ASML Holding NV		
	924	2,40	2 Broadcom Inc	1.345	3,49
Banken: 3,73 % (28. Februar 2022: 3,47 %)			1 NXP Semiconductors NV	266	0,69
21 Bank of America Corp	713	1,85	5 QUALCOMM Inc	586	1,52
5 JPMorgan Chase & Co	724	1,88	2 Texas Instruments Inc	359	0,93
	1.437	3,73		2.773	7,20
Getränke: 1,83 % (28. Februar 2022: 1,71 %)			Software: 9,72 % (28. Februar 2022: 9,22 %)		
12 Coca-Cola Co/The	707	1,83	6 Activision Blizzard Inc	490	1,27
Biotechnologie: 1,29 % (28. Februar 2022: 1,13 %)			8 Microsoft Corp	2.102	5,45
2 Amgen Inc	499	1,29	10 Oracle Corp	888	2,31
Chemie: 2,33 % (28. Februar 2022: 2,08 %)			2 Paychex Inc	266	0,69
2 Air Products & Chemicals Inc	457	1,18		3.746	9,72
15 Huntsman Corp	442	1,15	Telekommunikation: 2,44 % (28. Februar 2022: 2,88 %)		
	899	2,33	10 Cisco Systems Inc	484	1,26
Computer: 4,70 % (28. Februar 2022: 6,60 %)			12 Verizon Communications Inc	454	1,18
12 Apple Inc	1.812	4,70		938	2,44
Kosmetik u. Körperpflege: 1,56 % (28. Februar 2022: 1,58 %)			Transport: 1,45 % (28. Februar 2022: 0,74 %)		
4 Procter & Gamble Co/The	602	1,56	1 Union Pacific Corp	195	0,51
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 3,69 % (28. Februar 2022: 3,57 %)			2 United Parcel Service Inc 'B'	363	0,94
3 Apollo Global Management Inc	229	0,59		558	1,45
39 Blue Owl Capital Inc 'A'	481	1,25	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 22.275 \$)		
1 CME Group Inc	276	0,72		30.154	78,26
4 Intercontinental Exchange Inc	435	1,13	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen: 1,45 % (28. Februar 2022: 1,93 %)		
	1.421	3,69	Fluggesellschaften: 1,45 % (28. Februar 2022: 1,43 %)		
Elektrik: 4,78 % (28. Februar 2022: 3,22 %)			460 American Airlines Group Inc, 6.500 %, fällig 01.07.2025		
CAD	114	0,30		557	1,45
19 Brookfield Renewable Energy Partners LP/CA, MLP #	498	1,29	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 488 \$)		
5 DTE Energy Co	518	1,35		557	1,45
4 NextEra Energy Inc	295	0,76	Vorzugsaktien: 6,35 % (28. Februar 2022: 13,76 %)		
7 PPL Corp	179	0,46	Autoteile u. Ausstattung: 1,15 % (28. Februar 2022: 1,18 %)		
2 Sempra Energy	238	0,62	4 Aptiv Plc, Series A	444	1,15
	1.842	4,78	Elektrik: 1,34 % (28. Februar 2022: 2,51 %)		
Elektrische Komponenten u. Zubehör: 0,94 % (28. Februar 2022: 0,94 %)			11 NextEra Energy Inc	518	1,34
4 Emerson Electric Co	361	0,94	Gas: 0,38 % (28. Februar 2022: 0,96 %)		
Elektronik: 0,50 % (28. Februar 2022: 0,49 %)			3 Spire Inc, Series A	146	0,38
2 TE Connectivity Ltd	194	0,50	Gesundheit – Produkte: 0,37 % (28. Februar 2022: 1,88 %)		
Energie – Alternative Quellen: 0,97 % (28. Februar 2022: 0,92 %)			1 Boston Scientific Corp, Series A	141	0,37
6 NextEra Energy Partners LP	374	0,97	Medien: 0,69 % (28. Februar 2022: 1,05 %)		
Hand-/Maschinenwerkzeuge: 0,49 % (28. Februar 2022: 1,81 %)			9 Paramount Global, Series A	264	0,69
2 Stanley Black & Decker Inc	187	0,49	Private Equity: 2,42 % (28. Februar 2022: 2,41 %)		
Gesundheit – Produkte: 1,60 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			14 KKR & Co Inc, Series C	933	2,42
2 Danaher Corp	615	1,60	Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 2.636 \$)		
Haushaltswaren u. -artikel: 0,97 % (28. Februar 2022: 0,90 %)				2.446	6,35
3 Kimberly-Clark Corp	375	0,97	Real Estate Investment Trusts: 8,91 % (28. Februar 2022: 7,43 %)		
Versicherungen: 0,88 % (28. Februar 2022: 1,32 %)			REITs: 8,91 % (28. Februar 2022: 7,43 %)		
2 Chubb Ltd	341	0,88	43 AGNC Investment Corp	468	1,21
Investmentgesellschaften: 1,97 % (28. Februar 2022: 3,58 %)			4 Alexandria Real Estate Equities Inc	534	1,39
16 Ares Capital Corp	301	0,78	2 American Tower Corp	444	1,15
23 Barings BDC Inc	203	0,53	6 Apartment Income REIT Corp	232	0,60
19 Trinity Capital Inc	256	0,66	1 Crown Castle Inc	162	0,42
	760	1,97	1 Equinix Inc	395	1,03
Maschinen – Diversifiziert: 1,89 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			3 Equity LifeStyle Properties Inc	190	0,49
9 Otis Worldwide Corp	728	1,89	7 Gaming and Leisure Properties Inc	398	1,03
Öl u. Gas: 0,48 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			9 Global Medical REIT Inc	93	0,24
2 ConocoPhillips	184	0,48	2 Prologis Inc	239	0,62
Pharma: 6,46 % (28. Februar 2022: 5,07 %)			1 SBA Communications Corp 'A'	183	0,48
3 Johnson & Johnson	523	1,36	3 Weyerhaeuser Co	95	0,25
10 Merck & Co Inc	1.082	2,81		3.433	8,91
22 Pfizer Inc	883	2,29	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.874 \$)		
	2.488	6,46		3.433	8,91
Pipelines: 12,16 % (28. Februar 2022: 11,23 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 28.273 \$)		
7 DT Midstream Inc	329	0,85		36.590	94,97
18 Enbridge Inc	680	1,76	Devisenterminkontrakte: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
59 Equitrans Midstream Corp	356	0,92	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
37 Kinder Morgan Inc	634	1,65		1	–
6 ONEOK Inc	376	0,98	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
62 Plains GP Holdings LP 'A'	868	2,25		36.591	94,97
10 TC Energy Corp	380	0,99	Devisenterminkontrakte: -0,14 % (28. Februar 2022: -0,09 %)		
35 Williams Cos Inc/The	1.061	2,76	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	4.684	12,16		-56	-0,14
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-56	-0,14
			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
				36.535	94,83
			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
				1.993	5,17
			Gesamtnettovermögen		
				38.528 \$	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (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 %.

Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

CAD – Kanadischer Dollar

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,49
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	5,51
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	28	Verkauf	AUD	42	\$	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2	Verkauf	CNH	14		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	29	Verkauf	EUR	27		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	22	Verkauf	EUR	20		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	19	Verkauf	SGD	26		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	34	Verkauf	SGD	45		1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	882	Verkauf	USD	666		-11
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	850	Verkauf	USD	914		-14
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	432	Verkauf	USD	64		-2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	1.325	Verkauf	USD	921		-29
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 20 \$)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -38 \$)									-56
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -18 \$)								\$	-55

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 96,28 % (28. Februar 2022: 100,01 %)			Medien: 1,56 % (28. Februar 2022: 3,15 %)		
Bekleidung: 1,61 % (28. Februar 2022: 1,63 %)			258 Walt Disney Co/The 25.686 1,56		
222 NIKE Inc	26.365	1,61	Fertigung sonstige: 2,29 % (28. Februar 2022: 3,51 %)		
Autoteile u. Ausstattung: 1,25 % (28. Februar 2022: 1,33 %)			215 Eaton Corp Plc 37.593 2,29		
177 Aptiv Plc	20.507	1,25	Verpackung u. Behälter: 1,50 % (28. Februar 2022: 2,10 %)		
Banken: 6,59 % (28. Februar 2022: 6,68 %)			438 Ball Corp 24.647 1,50		
1.220 Bank of America Corp	41.816	2,55	Pharma: 5,46 % (28. Februar 2022: 2,62 %)		
219 First Republic Bank/CA	26.957	1,64	386 CVS Health Corp 32.220 1,97		
408 Morgan Stanley	39.356	2,40	179 Johnson & Johnson 27.457 1,67		
	108.129	6,59	211 Novo Nordisk A/S ADR 29.807 1,82		
Biotechnologie: 3,47 % (28. Februar 2022: 3,26 %)			89.484 5,46		
281 BioMarin Pharmaceutical Inc	27.976	1,71	Einzelhandel: 5,83 % (28. Februar 2022: 6,37 %)		
359 Gilead Sciences Inc	28.903	1,76	84 Costco Wholesale Corp 40.669 2,48		
	56.879	3,47	114 Home Depot Inc/The 33.653 2,05		
Baumaterialien: 3,27 % (28. Februar 2022: 1,47 %)			170 Williams-Sonoma Inc 21.229 1,30		
190 Trane Technologies Plc	35.113	2,14	95.551 5,83		
362 Trex Co Inc	18.502	1,13	Halbleiter: 3,66 % (28. Februar 2022: 3,87 %)		
	53.615	3,27	44 ASML Holding NV 27.176 1,66		
Chemie: 1,43 % (28. Februar 2022: 1,19 %)			424 ON Semiconductor Corp 32.835 2,00		
147 Ecolab Inc	23.455	1,43	60.011 3,66		
Gewerbliche Dienstleistungen: 1,20 % (28. Februar 2022: 0,97 %)			Software: 8,95 % (28. Februar 2022: 11,51 %)		
524 Progyny Inc	19.670	1,20	398 Microsoft Corp 99.261 6,05		
Computer: 6,53 % (28. Februar 2022: 5,47 %)			148 Salesforce Inc 24.269 1,48		
89 Accenture Plc 'A'	23.709	1,44	64 Synopsys Inc 23.203 1,42		
566 Apple Inc	83.411	5,09	146.733 8,95		
	107.120	6,53	Telekommunikation: 1,86 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen: 5,42 % (28. Februar 2022: 5,28 %)			631 Cisco Systems Inc 30.523 1,86		
34 BlackRock Inc	23.494	1,43	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.631.475 \$) 1.578.969 96,28		
396 Charles Schwab Corp/The	30.823	1,88	Real Estate Investment Trusts: 3,05 % (28. Februar 2022: 1,22 %)		
157 Visa Inc 'A'	34.559	2,11	REITs: 3,05 % (28. Februar 2022: 1,22 %)		
	88.876	5,42	30 Equinix Inc 20.929 1,27		
Elektrik: 1,29 % (28. Februar 2022: 3,15 %)			236 Prologis Inc 29.135 1,78		
CAD 759 Brookfield Renewable Corp	21.126	1,29	50.064 3,05		
Elektronik: 3,82 % (28. Februar 2022: 3,84 %)			Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 48.550 \$) 50.064 3,05		
182 Keysight Technologies Inc	29.089	1,77	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
264 TE Connectivity Ltd	33.544	2,05	bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.680.025 \$) 1.629.033 99,33		
	62.633	3,82	Devisenterminkontrakte: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,01 %)		
Energie – Alternative Quellen: 4,53 % (28. Februar 2022: 2,25 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 22 –		
58 Enphase Energy Inc	12.292	0,75	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
311 NextEra Energy Partners LP	20.599	1,26	bewerteten finanziellen Vermögenswerte 1.629.055 99,33		
733 Shoals Technologies Group Inc 'A'	17.968	1,09	Devisenterminkontrakte: -0,05 % (28. Februar 2022: -0,13 %)		
74 SolarEdge Technologies Inc	23.463	1,43	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -840 -0,05		
	74.322	4,53	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
Nahrungsmittel: 1,68 % (28. Februar 2022: 3,77 %)			bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten -840 -0,05		
371 McCormick & Co Inc/MD	27.589	1,68	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert		
Hand-/Maschinenwerkzeuge: 2,35 % (28. Februar 2022: 2,14 %)			bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 1.628.215 99,28		
244 Regal Rexnord Corp	38.524	2,35	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 11.764 0,72		
Gesundheit – Produkte: 5,15 % (28. Februar 2022: 5,71 %)			Gesamtvermögen 1.639.979 100,00		
74 Cooper Cos Inc/The	24.117	1,47			
121 Danaher Corp	30.009	1,83			
56 Thermo Fisher Scientific Inc	30.316	1,85			
	84.442	5,15			
Gesundheit – Dienstleistungen: 2,71 % (28. Februar 2022: 2,93 %)					
94 UnitedHealth Group Inc	44.479	2,71			
Versicherungen: 4,57 % (28. Februar 2022: 3,99 %)					
478 Hartford Financial Services Group Inc/The	37.432	2,28			
261 Progressive Corp/The	37.528	2,29			
	74.960	4,57			
Internet: 5,25 % (28. Februar 2022: 4,21 %)					
361 Alphabet Inc 'A'	32.522	1,99			
15 Booking Holdings Inc	37.593	2,29			
131 Etsy Inc	15.930	0,97			
	86.045	5,25			
Maschinen – Bau u. Bergbau: 0,86 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
651 Bloom Energy Corp 'A'	14.110	0,86			
Maschinen – Diversifiziert: 2,19 % (28. Februar 2022: 1,51 %)					
86 Deere & Co	35.895	2,19			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.400	Verkauf	EUR	1.317	\$ 8
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	27	Verkauf	EUR	25	–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2.920	Verkauf	GBP	2.416	11
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	130	Verkauf	GBP	109	-1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	30.569	Verkauf	USD	32.854	-489
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	65.150	Verkauf	USD	78.738	-350
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	89	Verkauf	USD	106	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	687	Verkauf	USD	725	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 145 \$)							\$	22
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.099 \$)								-840
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.954 \$)							\$	-818

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien: 97,30 % (28. Februar 2022: 89,23 %)					
Australien: 1,09 % (28. Februar 2022: 0,45 %)					
AUD	17	1,09			
Kanada: 3,76 % (28. Februar 2022: 4,08 %)					
CAD	– Constellation Software Inc/Canada	1,41			
CAD	1 Loblaw Cos Ltd	0,94			
CAD	– Lumine Group Inc ∞	0,02			
CAD	1 Shopify Inc 'A'	0,30			
CAD	1 Thomson Reuters Corp	1,09			
			496 3,76		
China: 3,72 % (28. Februar 2022: 0,31 %)					
HKD	12 Alibaba Group Holding Ltd	1,02			
HKD	3 Tencent Holdings Ltd	1,16			
HKD	46 TravelSky Technology Ltd	0,70			
HKD	3 Zai Lab Ltd ADR	0,84			
			490 3,72		
Frankreich: 3,20 % (28. Februar 2022: 5,56 %)					
EUR	3 BNP Paribas SA	1,43			
EUR	– EssilorLuxottica SA	0,50			
EUR	– LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1,27			
			421 3,20		
Deutschland: 4,64 % (28. Februar 2022: 1,66 %)					
EUR	1 Deutsche Börse AG	1,20			
EUR	13 Deutsche Telekom AG	2,19			
EUR	1 SAP SE	1,25			
			612 4,64		
Hongkong: 2,63 % (28. Februar 2022: 1,51 %)					
HKD	18 AIA Group Ltd	1,48			
HKD	4 Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	1,15			
			347 2,63		
Irland: 0,93 % (28. Februar 2022: 2,20 %)					
	3 CRH Plc ADR	0,93			
Israel: 0,93 % (28. Februar 2022: 0,84 %)					
	1 Nice Ltd ADR	0,93			
Japan: 5,48 % (28. Februar 2022: 2,92 %)					
JPY	6 Daiichi Sankyo Co Ltd	1,48			
JPY	– Hoya Corp	–			
JPY	– Keyence Corp	1,47			
JPY	11 Olympus Corp	1,38			
JPY	2 Sony Group Corp	1,15			
			722 5,48		
Niederlande: 1,61 % (28. Februar 2022: 1,59 %)					
EUR	– Argenx SE ADR	0,80			
EUR	– ASML Holding NV	0,81			
			212 1,61		
Portugal: 1,63 % (28. Februar 2022: 1,31 %)					
EUR	43 EDP – Energias de Portugal SA	1,63			
Spanien: 0,78 % (28. Februar 2022: 0,73 %)					
	2 Iberdrola SA ADR	0,78			
Schweden: 1,02 % (28. Februar 2022: 2,21 %)					
SEK	7 Sandvik AB	1,02			
Schweiz: 1,84 % (28. Februar 2022: 4,34 %)					
CHF	2 Alcon Inc	0,95			
CHF	1 Straumann Holding AG	0,89			
			242 1,84		
Vereinigtes Königreich: 4,29 % (28. Februar 2022: 4,33 %)					
GBP	1 Diageo Plc ADR	1,42			
GBP	1 London Stock Exchange Group Plc	0,90			
GBP	5 RELX Plc	1,06			
GBP	19 Rentokil Initial Plc	0,91			
			565 4,29		
USA: 59,75 % (28. Februar 2022: 51,62 %)					
	1 AbbVie Inc	1,02			
	1 Accenture Plc 'A'	1,28			
	1 Aflac Inc	0,69			
	3 Alphabet Inc 'A'	1,79			
	2 Amazon.com Inc	1,50			
	3 Apple Inc	3,20			
	5 Avantor Inc	0,91			
			7.874 59,75		
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 12.642 \$)				12.823	97,30
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				12.823	97,30
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				12.823	97,30
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				356	2,70
Gesamtvermögen				13.179 \$	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 %.					
∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.					
ABKÜRZUNGEN:					
ADR	– American Depositary Receipt				
AUD	– Australischer Dollar				
CAD	– Kanadischer Dollar				
CHF	– Schweizer Franken				
EUR	– Euro				
GBP	– Britisches Pfund Sterling				
HKD	– Hongkong-Dollar				
JPY	– Japanischer Yen				
SEK	– Schwedische Kronen				
Verteilung des Gesamtvermögens					% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden					96,99
Sonstige Vermögenswerte					3,01
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 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 93,42 % (28. Februar 2022: 90,15 %)		
Australien – 5,07 % (28. Februar 2022: 1,90 %)		
AUD 4.042 Atlas Arteria Ltd	17.548	1,65
AUD 4.035 Transurban Group	36.285	3,42
	53.833	5,07
Brasilien – 1,70 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
BRL 2.914 Centrais Eletricas Brasileiras SA	18.045	1,70
Kanada – 8,77 % (28. Februar 2022: 8,49 %)		
CAD 1.652 Gibson Energy Inc	26.257	2,47
CAD 937 Pembina Pipeline Corp	29.091	2,74
CAD 1.006 TC Energy Corp	37.840	3,56
	93.188	8,77
Frankreich – 6,89 % (28. Februar 2022: 9,99 %)		
3.006 Getlink SE	47.747	4,49
238 Vinci SA	25.529	2,40
	73.276	6,89
Italien – 3,23 % (28. Februar 2022: 2,55 %)		
4.861 Terna – Rete Elettrica Nazionale	34.362	3,23
Japan – 6,02 % (28. Februar 2022: 3,05 %)		
JPY 239 Central Japan Railway Co	25.345	2,39
JPY 809 East Japan Railway Co	38.596	3,63
	63.941	6,02
Portugal – 3,39 % (28. Februar 2022: 2,60 %)		
7.579 EDP – Energias de Portugal SA	36.082	3,39
Spanien – 11,53 % (28. Februar 2022: 11,97 %)		
179 Aena SME SA, 144A	26.127	2,46
959 Cellnex Telecom SA, 144A	34.037	3,20
941 Ferrovial SA	24.683	2,32
3.481 Iberdrola SA	37.714	3,55
	122.561	11,53
Vereinigtes Königreich – 10,87 % (28. Februar 2022: 7,75 %)		
GBP 1.416 Severn Trent Plc	44.216	4,16
GBP 2.260 SSE Plc	44.709	4,21
GBP 2.308 United Utilities Group Plc	26.641	2,50
	115.566	10,87
USA – 35,95 % (28. Februar 2022: 41,85 %)		
USD 161 American Water Works Co Inc	21.392	2,01
USD 179 Cheniere Energy Inc	26.648	2,51
USD 351 Constellation Energy Corp	24.859	2,34
USD 1.282 CSX Corp	36.941	3,48
USD 252 Entergy Corp	24.464	2,30
USD 724 NextEra Energy Inc	48.627	4,57
USD 764 OGE Energy Corp	25.815	2,43
USD 2.970 PG&E Corp	43.852	4,13
USD 1.448 PPL Corp	37.051	3,49
USD 589 Public Service Enterprise Group Inc	33.646	3,16
USD 349 Southwest Gas Holdings Inc	20.760	1,95
USD 194 Union Pacific Corp	38.008	3,58
	382.063	35,95
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.010.810 €)	992.917	93,42
Real Estate Investment Trusts – 3,73 % (28. Februar 2022: 6,41 %)		
USA – 3,73 % (28. Februar 2022: 6,41 %)		
USD 212 American Tower Corp	39.593	3,73
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 50.532 €)	39.593	3,73
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.061.342 €)	1.032.510	97,15
Devisenterminkontrakte — 0,18 % (28. Februar 2022: 0,48 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.921	0,18
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.034.431	97,33
Devisenterminkontrakte – -0,10 % (28. Februar 2022: -0,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.058	-0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.058	-0,10
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.033.373	97,23
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	29.460	2,77
Gesamtnettovermögen	1.062.833 €	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 60.164.000 € und machten 5,66 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,65
Finanzderivate	0,18
Sonstige Vermögenswerte	3,17
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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei		Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.981	Verkauf	BRL	16.291	€ 39
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	144	Verkauf	BRL	800	-1
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	17.091	Verkauf	EUR	3.086	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	625	Verkauf	AUD	974	5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	211	Verkauf	CNH	1.549	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	65	Verkauf	CNH	480	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	4.957	Verkauf	EUR	3.207	-54
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	176.346	Verkauf	EUR	24.188	-198
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	795	Verkauf	EUR	108	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	6.702	Verkauf	EUR	4.706	-9
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	120	Verkauf	EUR	85	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	368	Verkauf	EUR	413	5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	122.054	Verkauf	EUR	113.566	1.718
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	88	Verkauf	EUR	84	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	194	Verkauf	SGD	278	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	268	Verkauf	SGD	380	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.679	Verkauf	USD	1.798	-20
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	41	Verkauf	USD	43	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.020	Verkauf	AUD	1.574	19
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	3.444	Verkauf	AUD	3.710	25
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	669	Verkauf	AUD	1.170	17
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	347	Verkauf	BRL	1.944	-3
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	228	Verkauf	BRL	1.435	1
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	9	Verkauf	BRL	50	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	1.172	Verkauf	BRL	4.575	-11
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	1.441	Verkauf	CAD	2.342	16
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.312	Verkauf	CAD	3.319	15
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	19.890	Verkauf	EUR	13.855	-86
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	20	Verkauf	EUR	13	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	36	Verkauf	EUR	7	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	JPY	1.749	Verkauf	EUR	12	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	3.902	Verkauf	EUR	4.417	17
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	89	Verkauf	EUR	83	1
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.551	Verkauf	GBP	2.253	-11
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	8.254	Verkauf	GBP	5.080	-59
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	4.093	Verkauf	JPY	405.550	13
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1.211	Verkauf	JPY	172.245	13
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	795	Verkauf	JPY	128.007	14
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	191	Verkauf	USD	201	-
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	5.132	Verkauf	USD	6.238	-60
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	7.814	Verkauf	USD	8.394	-114
17. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CAD	26.405	Verkauf	USD	19.770	-392
4. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	15.586	Verkauf	EUR	2.829	-40
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 3.195 €)								€ 1.921
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -438 €)								-1.058
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 2.757 €)								€ 863

[^] 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 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 90,92 % (28. Februar 2022: 90,89 %)			Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,05 %)		
Australien – 9,91 % (28. Februar 2022: 9,51 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 24 0,01		
AUD	2.422	4,30	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 399.314 98,35		
AUD	2.394	2,71	Devisenterminkontrakte – -0,55 % (28. Februar 2022: -0,19 %)		
AUD	1.239	2,90	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -2.229 -0,55		
	40.244	9,91	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten -2.229 -0,55		
Brasilien – 3,91 % (28. Februar 2022: 3,30 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 397.085 97,80		
BRL	2.008	1,04	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 8.963 2,20		
BRL	1.362	1,94	Gesamt Nettovermögen 406.048 \$ 100,00		
BRL	504	0,93			
	15.871	3,91			
Kanada – 10,67 % (28. Februar 2022: 13,00 %)			– 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 %.		
CAD	149	1,38	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 19.000 \$ und machten 0,01 % des Nettovermögens aus.		
CAD	527	2,18			
CAD	321	2,60			
CAD	460	4,51			
	43.334	10,67			
China – 1,17 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			ABKÜRZUNGEN:		
HKD	1.119	1,16	AUD	– Australischer Dollar	
HKD	178	0,01	BRL	– Brasilianischer Real	
	4.748	1,17	CAD	– Kanadischer Dollar	
Italien – 4,87 % (28. Februar 2022: 4,00 %)			EUR	– Euro	
EUR	1.242	1,74	GBP	– Britisches Pfund Sterling	
EUR	2.578	3,13	HKD	– Hongkong-Dollar	
	19.780	4,87	JPY	– Japanischer Yen	
Japan – 3,51 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
JPY	367	3,51	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 96,27		
Portugal – 5,27 % (28. Februar 2022: 2,59 %)			Finanzderivate 0,01		
EUR	4.248	5,27	Sonstige Vermögenswerte 3,72		
Spanien – 11,64 % (28. Februar 2022: 13,05 %)			Gesamtvermögen 100,00		
EUR	697	3,08			
EUR	338	2,31			
EUR	1.700	4,80			
EUR	355	1,45			
	47.252	11,64			
Vereinigtes Königreich – 14,11 % (28. Februar 2022: 11,53 %)					
GBP	1.298	4,01			
GBP	904	2,20			
GBP	978	5,04			
GBP	952	2,86			
	57.318	14,11			
USA – 25,86 % (28. Februar 2022: 25,48 %)					
CAD	222	1,52			
	202	1,56			
	65	1,20			
	99	1,62			
	100	2,53			
	121	1,97			
	333	2,93			
	308	4,58			
	196	3,05			
	110	1,71			
	33	1,66			
	206	1,53			
	104.989	25,86			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 393.163 \$)					
Vorzugsaktien – 1,42 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Brasilien – 1,42 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
BRL	836	1,42			
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 7.702 \$)					
Real Estate Investment Trusts – 6,00 % (28. Februar 2022: 3,77 %)					
USA – 6,00 % (28. Februar 2022: 2,80 %)					
	58	2,85			
	98	3,15			
	24.368	6,00			
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 27.841 \$)					
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 428.706 \$)					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	555	Verkauf	AUD	818	\$	4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	262	Verkauf	AUD	389		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	248	Verkauf	EUR	235		-1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.684	Verkauf	EUR	1.583		7
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.268	Verkauf	SGD	1.692		13
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	5		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	90.507	Verkauf	USD	68.306		-1.159
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	4.871	Verkauf	USD	5.883		-23
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	8	Verkauf	USD	6		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	44.492	Verkauf	USD	47.824		-720
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	9	Verkauf	USD	10		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	9.553	Verkauf	USD	1.406		-30
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	13.387	Verkauf	USD	9.310		-296
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 82 \$)								\$	24
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -332 \$)									-2.229
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -250 \$)								\$	-2.205

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,39 % (28. Februar 2022: 4,57 %)					
32.545 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	32.545	4,39	34 Herc Holdings Inc	4.948	0,67
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 32.545 \$)			70 Korn Ferry	3.906	0,53
Stammaktien – 95,04 % (28. Februar 2022: 95,20 %)			33 LiveRamp Holdings Inc	772	0,10
Werbung – 0,59 % (28. Februar 2022: 0,09 %)			217 Resources Connection Inc	3.918	0,53
617 Entravision Communications Corp	4.051	0,54	97 Sterling Check Corp	1.231	0,16
317 Marin Software Inc	347	0,05	143 TrueBlue Inc	2.674	0,36
	4.398	0,59	41 V2X Inc	1.905	0,26
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 5,27 % (28. Februar 2022: 4,91 %)				28.947	3,90
101 AAR Corp	5.477	0,74	Computer – 1,39 % (28. Februar 2022: 0,62 %)		
280 Astronics Corp	4.276	0,58	568 Conduent Inc	2.251	0,30
66 Barnes Group Inc	2.794	0,38	161 Kyndryl Holdings Inc	2.519	0,34
103 Ducommun Inc	5.520	0,74	343 SecureWorks Corp	2.627	0,36
59 Hexcel Corp	4.294	0,58	72 TTEC Holdings Inc	2.895	0,39
67 Kaman Corp	1.728	0,23		10.292	1,39
189 Kratos Defense & Security Solutions Inc	2.392	0,32	Kosmetik u. Körperpflege – 0,30 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
215 Leonardo DRS Inc	2.791	0,38	19 Inter Parfums Inc	2.240	0,30
43 Mercury Systems Inc	2.223	0,30	Distribution u. Großhandel – 3,30 % (28. Februar 2022: 3,50 %)		
95 Spirit AeroSystems Holdings Inc 'A'	3.260	0,44	399 Hudson Technologies Inc	4.046	0,55
344 Triumph Group Inc	4.337	0,58	504 Manitex International Inc	2.596	0,35
	39.092	5,27	286 MRC Global Inc	3.202	0,43
Fluggesellschaften – 0,67 % (28. Februar 2022: 1,43 %)			182 Resideo Technologies Inc	3.341	0,45
52 Alaska Air Group Inc	2.469	0,33	50 Univar Solutions Inc	1.724	0,23
17 Allegiant Travel Co	1.714	0,23	107 VSE Corp	6.120	0,83
262 Mesa Air Group Inc	793	0,11	21 WESCO International Inc	3.443	0,46
	4.976	0,67		24.472	3,30
Bekleidung – 1,12 % (28. Februar 2022: 1,44 %)			Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,13 % (28. Februar 2022: 1,48 %)		
344 Fossil Group Inc	1.495	0,20	112 Air Lease Corp 'A'	4.854	0,66
173 Lakeland Industries Inc	2.635	0,35	62 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.026	0,27
75 Rocky Brands Inc	2.010	0,27	118 B. Riley Financial Inc	4.704	0,63
49 Skechers USA Inc	2.190	0,30	37 Focus Financial Partners Inc 'A'	1.929	0,26
	8.330	1,12	54 Moelis & Co 'A'	2.301	0,31
Automobilhersteller – 0,76 % (28. Februar 2022: 0,64 %)				15.814	2,13
206 Wabash National Corp	5.629	0,76	Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,16 % (28. Februar 2022: 0,32 %)		
Autoteile u. Ausstattung – 2,78 % (28. Februar 2022: 3,05 %)			351 American Superconductor Corp	1.891	0,26
85 Adient Plc	3.633	0,49	108 Insteel Industries Inc	3.203	0,43
570 Commercial Vehicle Group Inc	4.504	0,61	311 nLight Inc	3.522	0,47
156 Dana Inc	2.467	0,33		8.616	1,16
510 Garrett Motion Inc	3.936	0,53	Elektronik – 5,34 % (28. Februar 2022: 5,13 %)		
187 Goodyear Tire & Rubber Co/The	2.118	0,29	53 Advanced Energy Industries Inc	4.969	0,67
152 Shyft Group Inc/The	3.932	0,53	41 Avnet Inc	1.847	0,25
	20.590	2,78	157 Benchmark Electronics Inc	3.730	0,50
Banken – 1,67 % (28. Februar 2022: 2,27 %)			70 Coherent Corp	3.036	0,41
145 BayCom Corp	2.991	0,40	293 Comtech Telecommunications Corp	4.695	0,63
83 First Bancshares Inc/The	2.612	0,35	119 CTS Corp	5.169	0,70
110 Hilltop Holdings Inc	3.635	0,49	233 Identiv Inc	1.629	0,22
103 Seacoast Banking Corp of Florida	3.149	0,43	212 Knowles Corp	3.601	0,49
	12.387	1,67	243 Stoneridge Inc	5.783	0,78
Biotechnologie – 0,31 % (28. Februar 2022: 0,27 %)			132 Vishay Intertechnology Inc	2.809	0,38
137 NeoGenomics Inc	2.302	0,31	53 Vishay Precision Group Inc	2.299	0,31
Baumaterialien – 2,89 % (28. Februar 2022: 2,09 %)				39.567	5,34
25 Apogee Enterprises Inc	1.161	0,16	Energie – Alternative Quellen – 0,34 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
76 Gibraltar Industries Inc	4.086	0,55	217 TPI Composites Inc	2.502	0,34
102 Griffon Corp	3.721	0,50	Hoch- u. Tiefbau/Bauwesen – 3,93 % (28. Februar 2022: 2,83 %)		
265 Modine Manufacturing Co	6.475	0,87	33 Arcosa Inc	2.010	0,27
97 PGT Innovations Inc	2.060	0,28	17 Comfort Systems USA Inc	2.401	0,32
133 Summit Materials Inc 'A'	3.930	0,53	528 Concrete Pumping Holdings Inc	4.117	0,56
	21.433	2,89	153 Construction Partners Inc 'A'	4.148	0,56
Chemie – 1,84 % (28. Februar 2022: 2,35 %)			311 Limbach Holdings Inc	4.406	0,60
115 Huntsman Corp	3.370	0,45	476 Mistras Group Inc	2.609	0,35
136 Livent Corp	3.177	0,43	648 Orion Group Holdings Inc	1.804	0,24
70 Mativ Holdings Inc	1.818	0,24	167 Primoris Services Corp	4.598	0,62
142 Tronox Holdings Plc	2.219	0,30	79 Sterling Infrastructure Inc	3.030	0,41
298 Unifi Inc	3.088	0,42		29.123	3,93
	13.672	1,84	Unterhaltung – 0,32 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Gewerbliche Dienstleistungen – 3,90 % (28. Februar 2022: 3,39 %)			127 IMAX Corp	2.346	0,32
99 Acacia Research Corp	429	0,06	Umweltkontrolle – 0,55 % (28. Februar 2022: 0,48 %)		
29 Adtalem Global Education Inc	1.138	0,15	9 CECO Environmental Corp	136	0,02
387 Arlo Technologies Inc	1.472	0,20	109 Heritage-Crystal Clean Inc	3.910	0,53
90 Cross Country Healthcare Inc	2.391	0,32		4.046	0,55
102 Evercel Inc	233	0,03	Nahrungsmittel – 0,51 % (28. Februar 2022: 0,80 %)		
297 Healthcare Services Group Inc	3.930	0,53	120 Krispy Kreme Inc	1.560	0,21
			CAD 284 SunOpta Inc	2.186	0,30
				3.746	0,51

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – (Fortsetzung)			Medien – 0,48 % (28. Februar 2022: 1,23 %)		
Hand-/Maschinenwerkzeuge – 0,80 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			149 Thyry Holdings Inc 3.552 0,48		
41 Hurco Cos Inc	1.211	0,16	Metallherstellung u. -elemente – 2,27 % (28. Februar 2022: 1,84 %)		
285 Luxfer Holdings Plc	4.719	0,64	33 Helios Technologies Inc	2.236	0,30
	5.930	0,80	59 Mayville Engineering Co Inc	955	0,13
Gesundheit – Produkte – 2,02 % (28. Februar 2022: 1,26 %)			751 NN Inc	1.394	0,19
1.047 Accuray Inc	3.046	0,41	135 Northwest Pipe Co	5.210	0,70
229 Apyx Medical Corp	738	0,10	55 Olympic Steel Inc	2.857	0,38
213 Artivion Inc	2.820	0,38	230 TimkenSteel Corp	4.203	0,57
63 CareDx Inc	1.066	0,14		16.855	2,27
242 MiMedx Group Inc	1.162	0,16	Bergbau – 1,17 % (28. Februar 2022: 2,28 %)		
171 Tactile Systems Technology Inc	2.469	0,33	167 Century Aluminum Co	2.019	0,27
208 Varex Imaging Corp	3.679	0,50	708 Ferroglobe Plc	3.534	0,48
	14.980	2,02	CAD 397 Major Drilling Group International Inc	3.100	0,42
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,33 % (28. Februar 2022: 0,97 %)				8.653	1,17
384 Community Health Systems Inc	2.327	0,31	Fertigung diverse – 1,63 % (28. Februar 2022: 3,11 %)		
CAD 121 Quidt Home Medical Corp	762	0,10	41 EnPro Industries Inc	4.367	0,59
159 RadNet Inc	3.748	0,51	29 Fabrinet	3.518	0,47
110 Select Medical Holdings Corp	3.002	0,41	150 Trinity Industries Inc	4.197	0,57
	9.839	1,33		12.082	1,63
Bauunternehmen – 2,86 % (28. Februar 2022: 2,73 %)			Büroeinrichtung – 0,13 % (28. Februar 2022: 0,84 %)		
113 Beazer Homes USA Inc	1.681	0,23	112 Interface Inc 'A'	989	0,13
12 Cavco Industries Inc	3.435	0,46	Öl u. Gas – 2,57 % (28. Februar 2022: 2,84 %)		
33 Century Communities Inc	1.986	0,27	CAD 435 435 Baytex Energy Corp	1.680	0,23
28 MI Homes Inc	1.608	0,22	47 47 Chesapeake Energy Corp	3.799	0,51
69 Skyline Champion Corp	4.744	0,64	292 292 Earthstone Energy Inc 'A'	4.066	0,55
95 Taylor Morrison Home Corp 'A'	3.419	0,46	81 81 Matador Resources Co	4.372	0,59
33 Toll Brothers Inc	1.966	0,26	107 107 Northern Oil and Gas Inc	3.307	0,44
98 Tri Pointe Homes Inc	2.341	0,32	353 353 Southwestern Energy Co	1.871	0,25
	21.180	2,86		19.095	2,57
Wohnungseinrichtungen – 0,18 % (28. Februar 2022: 0,99 %)			Öl- u. Gasdienstleistungen – 2,41 % (28. Februar 2022: 0,99 %)		
422 VIA Optronics AG ADR	1.358	0,18	339 Archrock Inc	3.759	0,51
Haushaltswaren u. -artikel – 0,40 % (28. Februar 2022: 0,77 %)			114 DMC Global Inc	3.048	0,41
16 Helen of Troy Ltd	1.849	0,25	436 Mammoth Energy Services Inc	2.444	0,33
17 Spectrum Brands Holdings Inc	1.114	0,15	454 Matrix Service Co	2.875	0,39
	2.963	0,40	165 NOW Inc	2.114	0,28
Versicherungen – 0,33 % (28. Februar 2022: 1,24 %)			182 Ranger Energy Services Inc	1.955	0,26
43 Brighthouse Financial Inc	2.468	0,33	192 Solaris Oilfield Infrastructure Inc 'A'	1.713	0,23
Internet – 3,78 % (28. Februar 2022: 1,82 %)				17.908	2,41
166 Cars.com Inc	3.178	0,43	Verpackung u. Behälter – 0,47 % (28. Februar 2022: 0,50 %)		
779 comScore Inc	912	0,12	115 TriMas Corp	3.451	0,47
65 Criteo SA ADR	2.167	0,29	Pharma – 0,93 % (28. Februar 2022: 1,65 %)		
555 DHI Group Inc	2.349	0,32	122 Option Care Health Inc	3.748	0,51
454 Edgio Inc	556	0,07	89 Organon & Co	2.174	0,29
208 EverQuote Inc	2.837	0,38	679 Societal CDMO Inc	995	0,13
61 IAC Inc	3.154	0,43		6.917	0,93
167 Innovid Corp	282	0,04	Private Equity – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
357 LifeMD Inc	638	0,09	115 P10 Inc	1.235	0,17
326 Magnite Inc	3.626	0,49	Immobilien – 0,17 % (28. Februar 2022: 0,43 %)		
100 Overstock.com Inc	1.945	0,26	215 Anywhere Real Estate Inc	1.242	0,17
378 QuinStreet Inc	6.406	0,86	Einzelhandel – 7,40 % (28. Februar 2022: 8,23 %)		
	28.050	3,78	20 Asbury Automotive Group Inc	4.608	0,62
Eisen/Stahl – 3,20 % (28. Februar 2022: 2,81 %)			89 Aspen Aerogels Inc	965	0,13
144 ATI Inc	5.842	0,79	399 Barnes & Noble Education Inc	803	0,11
105 Carpenter Technology Corp	5.076	0,68	46 BlueLinX Holdings Inc	3.843	0,52
191 Cleveland-Cliffs Inc	4.073	0,55	191 Caleres Inc	4.985	0,67
71 Commercial Metals Co	3.657	0,49	528 Carrols Restaurant Group Inc	1.109	0,15
93 Haynes International Inc	5.086	0,69	403 Chico's FAS Inc	2.318	0,31
	23.734	3,20	282 Designer Brands Inc	2.761	0,37
Beherbergung – 0,61 % (28. Februar 2022: 0,61 %)			13 Dillard's Inc	4.606	0,62
142 Century Casinos Inc	1.317	0,18	623 Express Inc	632	0,09
197 Marcus Corp/The	3.178	0,43	69 Franchise Group Inc	1.925	0,26
	4.495	0,61	561 iMedia Brands Inc	436	0,06
Maschinen – Bau u. Bergbau – 1,43 % (28. Februar 2022: 0,65 %)			132 J Jill Inc	3.663	0,49
53 Argan Inc	2.066	0,28	349 JOANN Inc	1.270	0,17
729 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	4.719	0,63	42 Movado Group Inc	1.462	0,20
63 BWX Technologies Inc	3.844	0,52	577 Noodles & Co 'A'	3.363	0,45
	10.629	1,43	98 Nordstrom Inc	1.917	0,26
Maschinen – Diversifiziert – 2,02 % (28. Februar 2022: 1,67 %)			35 Patrick Industries Inc	2.553	0,35
118 CIRCOR International Inc	3.442	0,46	153 Ruth's Hospitality Group Inc	2.843	0,38
165 Ichor Holdings Ltd	5.425	0,73	45 Sonic Automotive Inc 'A'	2.584	0,35
535 Intevac Inc	3.873	0,52	224 Sportsman's Warehouse Holdings Inc	2.011	0,27
193 Power Solutions International Inc	557	0,08	121 Vera Bradley Inc	645	0,09
158 Twin Disc Inc	1.708	0,23	90 Victoria's Secret & Co	3.565	0,48
	15.005	2,02		54.867	7,40

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – (Fortsetzung)			Devisenterminkontrakte – -0,22 % (28. Februar 2022: -0,20 %)		
Sparen u. Kredite – 0,52 % (28. Februar 2022: 0,52 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
81 Axos Financial Inc	3.832	0,52		-1.623	-0,22
Halbleiter – 5,09 % (28. Februar 2022: 5,12 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
83 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	2.222	0,30		-1.623	-0,22
147 Amkor Technology Inc	3.791	0,51	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
365 Amtech Systems Inc	3.492	0,47		742.640	100,15
160 Cohu Inc	5.972	0,81	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
121 FormFactor Inc	3.643	0,49		-1.111	-0,15
52 inTEST Corp	768	0,10	Gesamtnettvermögen		
76 Kulicke & Soffa Industries Inc	4.053	0,55		741.529 \$	100,00
49 Onto Innovation Inc	4.016	0,54	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
147 Ultra Clean Holdings Inc	4.700	0,63	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
239 Veeco Instruments Inc	5.099	0,69			
	37.756	5,09			
Software – 1,81 % (28. Februar 2022: 2,90 %)			ABKÜRZUNGEN:		
141 ACV Auctions Inc	1.732	0,23	ADR	– American Depositary Receipt	
113 Avid Technology Inc	3.287	0,44	CAD	– Kanadischer Dollar	
83 Digi International Inc	2.770	0,38	Verteilung des Gesamtvermögens		
119 Digital Turbine Inc	1.283	0,17	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
131 HireRight Holdings Corp	1.446	0,20	95,17		
322 Immersion Corp	2.465	0,33	Organismen für gemeinsame Anlagen		
106 Viant Technology Inc	420	0,06	Finanzderivate		
	13.403	1,81	Sonstige Vermögenswerte		
Telekommunikation – 4,15 % (28. Februar 2022: 5,02 %)			Gesamtvermögen		
216 A10 Networks Inc	3.281	0,44	100,00		
214 ADTRAN Holdings Inc	3.729	0,50			
112 Aviat Networks Inc	3.968	0,54			
536 CalAmp Corp	2.283	0,31			
152 Cambium Networks Corp	3.053	0,41			
363 DZS Inc	3.856	0,52			
137 Frequency Electronics Inc	867	0,12			
338 Infinera Corp	2.390	0,32			
237 Ooma Inc	3.094	0,42			
556 PCTEL Inc	2.500	0,34			
174 Ribbon Communications Inc	775	0,10			
357 Terran Orbital Corp	949	0,13			
	30.745	4,15			
Transport – 3,64 % (28. Februar 2022: 3,50 %)					
262 Ardmore Shipping Corp	4.762	0,64			
468 Daseke Inc	3.802	0,51			
292 Diana Shipping Inc	1.347	0,18			
183 Dorian LPG Ltd	4.007	0,54			
44 Hub Group Inc 'A'	4.049	0,55			
267 Navigator Holdings Ltd	3.696	0,50			
384 Radiant Logistics Inc	2.188	0,30			
52 Scorpio Tankers Inc	3.132	0,42			
	26.983	3,64			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 682.879 \$)					
	704.716	95,04			
Real Estate Investment Trusts – 0,91 % (28. Februar 2022: 2,12 %)					
REITS – 0,91 % (28. Februar 2022: 2,12 %)					
111 Braemar Hotels & Resorts Inc	519	0,07			
70 Chatham Lodging Trust	855	0,11			
274 Macerich Co/The	3.274	0,44			
10 Ryman Hospitality Properties Inc	935	0,13			
63 Tanger Factory Outlet Centers Inc	1.198	0,16			
	6.781	0,91			
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 6.920 \$)					
	6.781	0,91			
Bezugsrechte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Gewerbliche Dienstleistungen – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
6 Acacia Research Corp Rights ∞	–	–			
Summe Bezugsrechte (Anschaffungskosten – \$)					
	–	–			
Optionsscheine – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
94 Triumph Group Inc	71	0,01			
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 154 \$)					
	71	0,01			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 722.498 \$)					
	744.113	100,35			
Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2022: 0,16 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
	150	0,02			
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
	744.263	100,37			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	8.379	Verkauf	BRL	43.439	\$ 82
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	43.439	Verkauf	USD	8.542	-245
3. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	50	Verkauf	CNH	349	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	878	Verkauf	AUD	1.274	19
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	419	Verkauf	CNH	2.854	8
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	5	Verkauf	EUR	5	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	2.711	Verkauf	EUR	2.535	27
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	14	Verkauf	GBP	12	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	8	Verkauf	SEK	83	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.518	Verkauf	SGD	2.029	13
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	35	Verkauf	SGD	47	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	19.156	Verkauf	USD	2.824	-64
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	349	Verkauf	USD	50	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	9.915	Verkauf	USD	6.889	-215
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	37.186	Verkauf	USD	28.063	-473
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	392	Verkauf	USD	473	-2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	16.728	Verkauf	USD	3.776	-20
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	901	Verkauf	USD	85	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	12	Verkauf	USD	1	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	123	Verkauf	USD	131	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	32.704	Verkauf	USD	35.152	-528
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	3	Verkauf	USD	3	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	1	Verkauf	USD	1	-
4. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	34.767	Verkauf	USD	6.671	-76
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1.468 \$)							\$	150
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.791 \$)								-1.623
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -323 \$)							\$	-1.473

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,48 % (28. Februar 2022: 3,45 %)			Beherrschung – 1,99 % (28. Februar 2022: 2,40 %)		
11 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.619	2,07	168 Century Casinos Inc	1.555	1,99
1.100 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.100	1,41	Maschinen – Diversifiziert – 3,50 % (28. Februar 2022: 3,41 %)		
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.651 \$)	2.719	3,48	24 Esab Corp	1.416	1,81
Stammaktien – 97,23 % (28. Februar 2022: 97,15 %)			6 Kadant Inc	1.318	1,69
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,09 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Metalherstellung u. -elemente – 0,65 % (28. Februar 2022: 0,53 %)		
65 Leonardo DRS Inc	849	1,09	13 Northwest Pipe Co	505	0,65
Bekleidung – 2,41 % (28. Februar 2022: 1,62 %)			Fertigung diverse – 5,33 % (28. Februar 2022: 4,62 %)		
6 Carter's Inc	415	0,53	21 ESCO Technologies Inc	1.949	2,50
15 Steven Madden Ltd	556	0,71	20 John Bean Technologies Corp	2.212	2,83
54 Wolverine World Wide Inc	910	1,17	Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,54 % (28. Februar 2022: 1,92 %)		
	1.881	2,41	CAD 113 Pason Systems Inc	1.206	1,54
Autoteile u. Ausstattung – 3,47 % (28. Februar 2022: 4,77 %)			Pharma – 3,27 % (28. Februar 2022: 3,26 %)		
53 Gentex Corp	1.500	1,92	28 Catalyst Pharmaceuticals Inc	431	0,55
44 Miller Industries Inc/TN	1.214	1,55	25 Harmony Biosciences Holdings Inc	1.107	1,42
	2.714	3,47	90 Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'	1.013	1,30
Baumaterialien – 2,02 % (28. Februar 2022: 4,76 %)			Immobilien – 3,88 % (28. Februar 2022: 3,72 %)		
27 Louisiana-Pacific Corp	1.579	2,02	141 Kennedy-Wilson Holdings Inc	2.357	3,02
Chemie - 3,48 % (28. Februar 2022: 3,30 %)			20 Marcus & Millichap Inc	672	0,86
16 Innospec Inc	1.787	2,29	Einzelhandel – 1,49 % (28. Februar 2022: 1,67 %)		
5 Quaker Chemical Corp	935	1,19	34 Movado Group Inc	1.160	1,49
	2.722	3,48	Halbleiter – 9,18 % (28. Februar 2022: 10,20 %)		
Gewerbliche Dienstleistungen – 7,42 % (28. Februar 2022: 9,47 %)			31 Cohu Inc	1.166	1,50
7 AMN Healthcare Services Inc	639	0,82	65 FormFactor Inc	1.947	2,49
114 Computer Task Group Inc	852	1,09	8 Kulicke & Soffa Industries Inc	423	0,54
84 Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.010	1,29	23 MKS Instruments Inc	2.233	2,86
50 Forrester Research Inc	1.638	2,10	17 Onto Innovation Inc	1.397	1,79
30 Korn Ferry	1.658	2,12	Software – 2,94 % (28. Februar 2022: 6,42 %)		
	5.797	7,42	47 Avid Technology Inc	1.365	1,75
Kosmetik u. Körperpflege – 2,16 % (28. Februar 2022: 2,01 %)			24 Simulations Plus Inc	932	1,19
14 Inter Parfums Inc	1.687	2,16	Transport – 3,63 % (28. Februar 2022: 2,01 %)		
Distribution u. Großhandel – 2,20 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			11 Forward Air Corp	1.146	1,46
85 Hudson Technologies Inc	858	1,10	9 Landstar System Inc	1.693	2,17
21 IAA Inc	859	1,10	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 72.866 \$)		
	1.717	2,20	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 75.517 \$)		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 7,55 % (28. Februar 2022: 5,50 %)			Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
45 Air Lease Corp 'A'	1.959	2,51	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
49 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.610	2,06	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
20 Houlihan Lokey Inc 'A'	1.916	2,45	78.654		
11 Lazard Ltd 'A'	410	0,53	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
	5.895	7,55	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Elektronik – 5,96 % (28. Februar 2022: 5,29 %)			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
22 Brady Corp 'A'	1.197	1,53	-2		
30 FARO Technologies Inc	808	1,04	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
53 Kimball Electronics Inc	1.329	1,70	78.652		
30 Vishay Precision Group Inc	1.321	1,69	Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten		
	4.655	5,96	-554		
Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 2,22 % (28. Februar 2022: 3,64 %)			Gesamtneuvermögen		
29 Arcosa Inc	1.737	2,22	78.098 \$		
Umweltkontrolle – 0,88 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			100,00		
19 Heritage-Crystal Clean Inc	684	0,88			
Gesundheit – Produkte – 5,87 % (28. Februar 2022: 4,64 %)					
30 Bio-Techne Corp	2.151	2,75			
33 Enovis Corp	1.927	2,47			
4 UFP Technologies Inc	505	0,65			
	4.583	5,87			
Bauunternehmen – 3,71 % (28. Februar 2022: 1,60 %)					
10 LCI Industries	1.129	1,44			
26 Skyline Champion Corp	1.773	2,27			
	2.902	3,71			
Versicherungen – 4,88 % (28. Februar 2022: 4,13 %)					
12 RLI Corp	1.627	2,08			
2 White Mountains Insurance Group Ltd	2.185	2,80			
	3.812	4,88			
Internet – 2,92 % (28. Februar 2022: 1,67 %)					
29 Ziff Davis Inc	2.277	2,92			
Freizeit – 1,59 % (28. Februar 2022: 2,40 %)					
14 Brunswick Corp/DE	1.241	1,59			

– 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 Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,34
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,45
Sonstige Vermögenswerte	0,21
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	9	Verkauf	EUR	8	\$	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	-	Verkauf	SEK	1		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	1	Verkauf	USD	-		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SEK	17	Verkauf	USD	2		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	101	Verkauf	USD	108		-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1 \$)									-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -5 \$)									-2
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -4 \$)									\$ -2

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	Nettoinventarwert	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,24 % (28. Februar 2022: 3,09 %)							
180	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	180	4,24				
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 180 \$)							
Stammaktien – 96,21 % (28. Februar 2022: 97,25 %)							
Australien – 3,53 % (28. Februar 2022: 6,94 %)							
AUD	23 Hansen Technologies Ltd	73	1,72				
AUD	14 IPH Ltd	77	1,81				
		150	3,53				
Brasilien – 1,03 % (28. Februar 2022: 1,10 %)							
BRL	20 Odontoprev SA	44	1,03				
Kanada – 1,16 % (28. Februar 2022: 1,45 %)							
1	Ritchie Bros Auctioneers Inc	49	1,16				
Deutschland – 1,79 % (28. Februar 2022: 1,77 %)							
EUR	– New Work SE	76	1,79				
Italien – 3,01 % (28. Februar 2022: 4,05 %)							
EUR	1 Carel Industries SpA, 144A	31	0,73				
EUR	– DiaSorin SpA	41	0,97				
EUR	11 GVS SpA, 144A	56	1,31				
		128	3,01				
Japan – 11,67 % (28. Februar 2022: 11,32 %)							
JPY	1 As One Corp	29	0,69				
JPY	4 BML Inc	84	1,97				
JPY	1 Fukui Computer Holdings Inc	24	0,58				
JPY	3 JCU Corp	75	1,77				
JPY	2 Meitec Corp	29	0,67				
JPY	3 OBIC Business Consultants Co Ltd	94	2,21				
JPY	3 TKC Corp	86	2,03				
JPY	2 USS Co Ltd	31	0,72				
JPY	2 Zuken Inc	44	1,03				
		496	11,67				
Niederlande – 2,14 % (28. Februar 2022: 2,75 %)							
EUR	– IMCD NV	58	1,37				
EUR	8 Marel hf, 144A	33	0,77				
		91	2,14				
Polen – 1,33 % (28. Februar 2022: 1,37 %)							
PLN	3 Asseco Poland SA	57	1,33				
Singapur – 1,01 % (28. Februar 2022: 2,74 %)							
GBP	2 XP Power Ltd	43	1,01				
Südkorea – 1,99 % (28. Februar 2022: 0,00 %)							
KRW	1 Douzone Bizon Co Ltd	27	0,63				
KRW	6 NICE Information Service Co Ltd	58	1,36				
		85	1,99				
Schweden – 1,07 % (28. Februar 2022: 2,99 %)							
SEK	9 Karnov Group AB	46	1,07				
Schweiz – 1,79 % (28. Februar 2022: 1,96 %)							
CHF	– Kardex Holding AG	33	0,78				
CHF	1 VZ Holding AG	43	1,01				
		76	1,79				
Vereinigtes Königreich – 12,45 % (28. Februar 2022: 10,02 %)							
GBP	1 Croda International Plc	51	1,19				
GBP	1 Diploma Plc	47	1,10				
GBP	7 DiscoverE Group Plc	76	1,79				
GBP	1 Intertek Group Plc	42	0,99				
GBP	53 Learning Technologies Group Plc	90	2,12				
GBP	10 Marlowe Plc	56	1,32				
GBP	19 Restore Plc	73	1,71				
GBP	– Spirax-Sarco Engineering Plc	54	1,27				
GBP	2 Victrex Plc	41	0,96				
		530	12,45				
USA – 52,24 % (28. Februar 2022: 48,79 %)							
1	Arcosa Inc	67	1,59				
1	Avid Technology Inc	31	0,72				
1	Brunswick Corp/DE	76	1,78				
1	Cognex Corp	39	0,92				
1	Colliers International Group Inc	81	1,91				
1	Dorman Products Inc	79	1,86				
1	Enovis Corp	53	1,25				
1	Esab Corp	51	1,20				
1	ESCO Technologies Inc	54	1,28				
1	FirstService Corporation	87	2,04				
3	FormFactor Inc	78	1,82				
2	Forrester Research Inc	57	1,33				
1	Forward Air Corp	72	1,71				
2	Gentex Corp	56	1,32				
1	Haemonetics Corp	67	1,58				
–	Houlihan Lokey Inc 'A'	35	0,83				
1	IAA Inc	43	1,00				
1	Innospec Inc	73	1,73				
1	Inter Parfums Inc	93	2,19				
1	John Bean Technologies Corp	66	1,54				
–	Kadant Inc	74	1,74				
5	Kennedy-Wilson Holdings Inc	78	1,84				
–	Landstar System Inc	53	1,25				
–	LCI Industries	56	1,32				
–	Lincoln Electric Holdings Inc	61	1,43				
–	Littelfuse Inc	38	0,90				
1	LKQ Corp	31	0,72				
–	Marcus & Millichap Inc	17	0,39				
1	MKS Instruments Inc	78	1,84				
–	Quaker Chemical Corp	79	1,87				
1	Ralph Lauren Corp 'A'	82	1,93				
–	Rogers Corp	24	0,57				
1	SEI Investments Co	69	1,61				
–	TechTarget Inc	17	0,39				
1	UFP Industries Inc	66	1,54				
–	Valmont Industries Inc	65	1,52				
1	Ziff Davis Inc	76	1,78				
		2.222	52,24				
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.561 \$)				4.093	96,21		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				4.273	100,45		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				4.273	100,45		
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten				-19	-0,45		
Gesamtnettovermögen				4.254 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 120.000 \$ und machten 2,81 % des Nettovermögens aus.							
ABKÜRZUNGEN:							
AUD	– Australischer Dollar						
BRL	– Brasilianischer Real						
CHF	– Schweizer Franken						
EUR	– Euro						
GBP	– Britisches Pfund Sterling						
JPY	– Japanischer Yen						
KRW	– Südkoreanischer Won						
PLN	– Polnischer Zloty						
SEK	– Schwedische Kronen						
Verteilung des Gesamtvermögens							
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden						% des Gesamtvermögens	
Organismen für gemeinsame Anlagen						95,61	
Sonstige Vermögenswerte						4,20	
Gesamtvermögen						100,00	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^μ

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2022: 97,09 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,45 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 313 €)	–
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtvermögen	€ –

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

† Nicht liquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund Sterling

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

^μ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 97,90 % (28. Februar 2022: 98,26 %)					
Australien – 11,73 % (28. Februar 2022: 6,56 %)					
AUD	118	Aurizon Holdings Ltd	262	1,25	
AUD	15	BHP Group Ltd	454	2,15	
AUD	25	Coles Group Ltd	309	1,47	
AUD	7	JB Hi-Fi Ltd	182	0,86	
AUD	32	McMillan Shakespeare Ltd	307	1,46	
AUD	119	Orora Ltd	281	1,33	
AUD	5	Rio Tinto Ltd	397	1,88	
AUD	4	Sonic Healthcare Ltd	87	0,41	
AUD	8	Woodside Energy Group Ltd	194	0,92	
			2.473	11,73	
China – 28,23 % (28. Februar 2022: 32,86 %)					
HKD	1.000	Bank of China Ltd	366	1,74	
HKD	500	Bank of Communications Co Ltd	296	1,40	
HKD	510	China CITIC Bank Corp Ltd	236	1,12	
HKD	574	China Communications Services Corp Ltd	224	1,06	
HKD	650	China Construction Bank Corp	398	1,89	
HKD	162	China Medical System Holdings Ltd	245	1,16	
HKD	81	China Pacific Insurance Group Co Ltd	216	1,02	
HKD	350	China Railway Group Ltd	183	0,87	
HKD	100	China Shenhua Energy Co Ltd	301	1,43	
HKD	1.844	China Tower Corp Ltd, 144A	201	0,95	
HKD	750	CITIC Telecom International Holdings Ltd	274	1,30	
HKD	100	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	107	0,51	
HKD	127	EKA Fashion Holdings Ltd	173	0,82	
HKD	365	Far East Horizon Ltd	324	1,54	
HKD	230	Fu Shou Yuan International Group Ltd	173	0,82	
HKD	54	Hengan International Group Co Ltd	248	1,18	
HKD	110	Lenovo Group Ltd	99	0,47	
HKD	600	PetroChina Co Ltd	306	1,45	
HKD	290	PICC Property & Casualty Co Ltd	254	1,21	
HKD	430	Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	259	1,23	
HKD	503	Sinopec Engineering Group Co Ltd	252	1,19	
HKD	145	Tingyi Cayman Islands Holding Corp	235	1,11	
HKD	344	Uni-President China Holdings Ltd	302	1,43	
HKD	500	Yuexiu Transport Infrastructure Ltd	281	1,33	
			5.953	28,23	
Hongkong – 8,32 % (28. Februar 2022: 7,79 %)					
HKD	30	AIA Group Ltd	319	1,51	
HKD	1.026	Giordano International Ltd	249	1,18	
HKD	81	Hysan Development Co Ltd	255	1,21	
		Jardine Matheson Holdings Ltd	263	1,25	
HKD	68	Luk Fook Holdings International Ltd	218	1,03	
HKD	271	Stella International Holdings Ltd	262	1,24	
HKD	34	VTech Holdings Ltd	189	0,90	
			1.755	8,32	
Indien – 7,01 % (28. Februar 2022: 7,59 %)					
INR	20	Infosys Ltd	360	1,71	
INR	726	NHPC Ltd	349	1,65	
INR	110	Power Grid Corp of India Ltd	295	1,40	
INR	200	REC Ltd	277	1,31	
INR	61	Vedanta Ltd	197	0,94	
			1.478	7,01	
Indonesien – 5,22 % (28. Februar 2022: 2,89 %)					
IDR	549	Adaro Energy Indonesia Tbk PT	108	0,51	
IDR	567	Astra International Tbk PT	227	1,08	
IDR	600	Indofood Sukses Makmur Tbk PT	256	1,21	
IDR	1.000	Telkom Indonesia Persero Tbk PT	255	1,21	
IDR	140	United Tractors Tbk PT	256	1,21	
			1.102	5,22	
Malaysia – 2,28 % (28. Februar 2022: 3,07 %)					
MYR	1.100	Astro Malaysia Holdings Bhd	148	0,70	
MYR	75	Malayan Banking Bhd	147	0,69	
MYR	117	Petronas Chemicals Group Bhd	187	0,89	
			482	2,28	
Pakistan – 0,44 % (28. Februar 2022: 0,72 %)					
PKR	208	MCB Bank Ltd	93	0,44	
Philippinen – 1,47 % (28. Februar 2022: 1,40 %)					
PHP	454	Aboitiz Power Corp	310	1,47	
Singapur – 1,24 % (28. Februar 2022: 1,05 %)					
SGD	12	Jardine Cycle & Carriage Ltd	261	1,24	
Südkorea – 13,46 % (28. Februar 2022: 14,32 %)					
KRW	10	GS Retail Co Ltd	225	1,07	
KRW	7	KB Financial Group Inc	251	1,19	
KRW	3	Kia Corp	171	0,81	
		KT Corp ADR	185	0,88	
KRW	4	KT&G Corp	236	1,12	
KRW	30	LG Uplus Corp	247	1,17	
KRW	1	POSCO Holdings Inc	193	0,91	
KRW	22	Samsung Electronics Co Ltd	1.026	4,86	
KRW	2	SK Hynix Inc	121	0,58	
KRW	5	SK Telecom Co Ltd	184	0,87	
			2.839	13,46	
Taiwan – 17,11 % (28. Februar 2022: 18,84 %)					
TWD	180	Asia Cement Corp	264	1,25	
TWD	51	Chicony Electronics Co Ltd	153	0,73	
TWD	260	Kindom Development Co Ltd	248	1,18	
TWD	142	Lite-On Technology Corp	323	1,53	
TWD	30	Micro-Star International Co Ltd	134	0,63	
TWD	58	Pacific Hospital Supply Co Ltd	148	0,70	
TWD	15	Poya International Co Ltd	282	1,34	
TWD	13	Realtek Semiconductor Corp	160	0,76	
TWD	354	SinoPac Financial Holdings Co Ltd	198	0,94	
TWD	70	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.160	5,50	
TWD	155	Uni-President Enterprises Corp	342	1,62	
TWD	120	United Microelectronics Corp	196	0,93	
			3.608	17,11	
Thailand – 1,39 % (28. Februar 2022: 1,17 %)					
THB	101	Tisco Financial Group PCL, NVDR	293	1,39	
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 23.424 \$)			20.647	97,90	
Real Estate Investment Trusts – 1,11 % (28. Februar 2022: 1,80 %)					
Australien – 1,11 % (28. Februar 2022: 1,09 %)					
AUD	76	Charter Hall Long Wale REIT	235	1,11	
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 288 \$)			235	1,11	
Bezugsrechte – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
Thailand – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
TWD	19	SinoPac Financial Holdings Co Ltd Rights ∞	1	0,01	
Summe Bezugsrechte (Anschaffungskosten – \$)			1	0,01	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 23.712 \$)			20.883	99,02	
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,13 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			–	–	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			20.883	99,02	
Devisenterminkontrakte – -0,43 % (28. Februar 2022: -0,54 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-90	-0,43	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			-90	-0,43	
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			20.793	98,59	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			297	1,41	
Gesamtnettovermögen			21.090 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 460.000 \$ und machten 2,18 % des Nettovermögens aus.					
∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.					
ABKÜRZUNGEN:					
ADR	–	American Depositary Receipt			
NVDR	–	Non Voting Depositary Receipt			
AUD	–	Australischer Dollar			
HKD	–	Hongkong-Dollar			
IDR	–	Indonesische Rupiah			
INR	–	Indische Rupie			
KRW	–	Südkoreanischer Won			
MYR	–	Malaysischer Ringgit			
PHP	–	Philippinischer Peso			
PKR	–	Pakistanische Rupie			
SGD	–	Singapur-Dollar			
THB	–	Thailändischer Baht			
TWD	–	Taiwanesischer Dollar			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,81
Sonstige Vermögenswerte	2,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)			
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	87	Verkauf	AUD	128	\$	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	6	Verkauf	CNH	42		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	PLN	5		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	2		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	-	Verkauf	USD	-		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	PLN	163	Verkauf	USD	37		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	1.246	Verkauf	USD	184		-4
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	3.914	Verkauf	USD	2.720		-85
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	45	Verkauf	USD	34		-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 34 \$)									-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -139 \$)									-90
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -105 \$)								\$	-90

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)	
Griechenland: 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)	
EUR	1 FF Group †
Hongkong – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,00 %)	
HKD	38 Hanergy Mobile Energy Holding Group Co Ltd †
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 44 \$)	
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	
Gesamtvermögen	

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

† Nicht liquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

EUR – Euro
HKD – Hongkong-Dollar

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2022: 90,46 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,16 %)	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 54 \$)	–
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtnettvermögen	\$–

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

† Nicht liquide.

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

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

^α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,05 % (28. Februar 2022: 0,00 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	95,23
HKD	23 iShares Core MSCI Asia ex Japan ETF – ETF	143	Organismen für gemeinsame Anlagen	3,94
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 147 \$)			Sonstige Vermögenswerte	0,83
			Gesamtvermögen	100,00
Stammaktien – 97,66 % (28. Februar 2022: 95,93 %)				
China – 36,39 % (28. Februar 2022: 33,22 %)				
HKD	14 Alibaba Group Holding Ltd	149		4,23
HKD	112 CSPC Pharmaceutical Group Ltd	120		3,39
HKD	9 ENN Energy Holdings Ltd	124		3,51
HKD	86 Guangdong Investment Ltd	87		2,46
HKD	3 JD.com Inc	68		1,93
HKD	2 Meituan 'B', 144A	36		1,03
HKD	38 Minth Group Ltd	99		2,79
HKD	14 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	96		2,70
HKD	43 Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	70		1,97
HKD	6 Shenzhou International Group Holdings Ltd	66		1,86
HKD	5 Tencent Holdings Ltd	224		6,34
HKD	36 Tongcheng Travel Holdings Ltd	71		2,00
HKD	39 TravelSky Technology Ltd	77		2,18
				1,287
				36,39
Hongkong – 7,56 % (28. Februar 2022: 11,51 %)				
HKD	17 AIA Group Ltd	183		5,17
HKD	9 Techtronic Industries Co Ltd	84		2,39
				267
				7,56
Indien – 7,09 % (28. Februar 2022: 11,79 %)				
INR	10 HDFC Bank Ltd	197		5,56
INR	1 Tata Consultancy Services Ltd	54		1,53
				251
				7,09
Indonesien – 1,88 % (28. Februar 2022: 2,24 %)				
IDR	261 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	67		1,88
Singapur – 15,89 % (28. Februar 2022: 12,02 %)				
SGD	48 Singapore Technologies Engineering Ltd	128		3,61
SGD	82 Singapore Telecommunications Ltd	144		4,06
SGD	7 United Overseas Bank Ltd	159		4,51
SGD	10 Venture Corp Ltd	131		3,71
				562
				15,89
Südkorea – 16,49 % (28. Februar 2022: 13,49 %)				
KRW	1 Hansol Chemical Co Ltd	89		2,50
KRW	1 LEENO Industrial Inc	70		1,97
KRW	– LG Chem Ltd	117		3,31
KRW	– LG Energy Solution Ltd	75		2,12
KRW	5 Samsung Electronics Co Ltd	233		6,59
				584
				16,49
Taiwan – 12,36 % (28. Februar 2022: 11,66 %)				
TWD	13 Accton Technology Corp	119		3,37
TWD	6 Feng TAY Enterprise Co Ltd	36		1,02
TWD	17 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	282		7,97
				437
				12,36
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.015 \$)				3.455
				97,66
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				3.598
				101,71
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				3.598
				101,71
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten				-60
				-1,71
Gesamtvermögen				3.538 \$
				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 2023 belaufen sich diese Wertpapiere auf 36.000 \$ und machten 1,03 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

ETF	– Börsengehandelter Fonds
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
INR	– Indische Rupie
KRW	– Südkoreanischer Won
SGD	– Singapur-Dollar
TWD	– Taiwanesischer Dollar

[^] 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 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 101,05 % (28. Februar 2022: 100,64 %)		
China – 3,03 % (28. Februar 2022: 5,85 %)		
HKD 611 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	4.272	3,03
Dänemark – 3,50 % (28. Februar 2022: 3,01 %)		
DKK 43 Coloplast A/S	4.935	3,50
Frankreich – 10,14 % (28. Februar 2022: 7,01 %)		
EUR 7 Kering SA	3.874	2,75
EUR 15 L'Oreal SA	6.073	4,31
EUR 21 Pernod Ricard SA	4.348	3,08
	14.295	10,14
Hongkong – 3,04 % (28. Februar 2022: 2,86 %)		
HKD 404 AIA Group Ltd	4.292	3,04
Irland – 5,88 % (28. Februar 2022: 7,96 %)		
EUR 32 Kerry Group Plc	3.076	2,18
EUR 80 Kingspan Group Plc	5.215	3,70
	8.291	5,88
Italien – 8,65 % (28. Februar 2022: 7,27 %)		
EUR 23 Ferrari NV	5.893	4,18
EUR 103 Moncler SpA	6.314	4,47
	12.207	8,65
Niederlande – 5,90 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
EUR 14 ASML Holding NV	8.322	5,90
Schweden – 9,97 % (28. Februar 2022: 10,75 %)		
SEK 172 Assa Abloy AB	4.205	2,98
SEK 456 Atlas Copco AB	5.427	3,85
SEK 400 Hexagon AB	4.432	3,14
	14.064	9,97
Vereinigtes Königreich – 7,55 % (28. Februar 2022: 6,55 %)		
GBP 37 Croda International Plc	2.902	2,06
GBP 204 Dr Martens Plc	389	0,27
21 Linde Plc	7.358	5,22
	10.649	7,55
USA – 43,39 % (28. Februar 2022: 38,07 %)		
AUD 10 Adobe Inc	3.213	2,28
15 ANSYS Inc	4.416	3,13
17 Autodesk Inc	3.468	2,46
23 CSL Ltd	4.608	3,27
14 Illumina Inc	2.751	1,95
26 Masimo Corp	4.332	3,07
16 Mastercard Inc	5.513	3,91
28 Microsoft Corp	6.903	4,89
37 NIKE Inc	4.445	3,15
35 NVIDIA Corp	8.051	5,71
27 ResMed Inc	5.815	4,12
21 Veeva Systems Inc 'A'	3.426	2,43
26 Zoetis Inc	4.261	3,02
	61.202	43,39
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 159.607 \$)	142.529	101,05
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 159.607 \$)	142.529	101,05
Devisenterminkontrakte – 0,03 % (28. Februar 2022: 0,12 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	41	0,03
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	142.570	101,08
Devisenterminkontrakte – -1,01 % (28. Februar 2022: -1,25 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.422	-1,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-1.422	-1,01
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	141.148	100,07
Sonstige Vermögenswerte übersteigende Verbindlichkeiten	-99	-0,07
Gesamtnettovermögen	141.049 \$	100,00

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
DKK	– Dänische Krone
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HKD	– Hongkong-Dollar
SEK	– Schwedische Kronen

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	99,70
Finanzderivate	0,03
Sonstige Vermögenswerte	0,27
Gesamtvermögen	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 4.272.000 \$ und machten 3,03 % des Nettovermögens aus.

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	1.803	Verkauf	EUR	1.707	\$	-5
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	4.494	Verkauf	EUR	4.207		41
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	53	Verkauf	GBP	44		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	115	Verkauf	GBP	96		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	88.601	Verkauf	USD	95.208		-1.405
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	2.283	Verkauf	USD	2.760		-12
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	28	Verkauf	USD	30		-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	GBP	30	Verkauf	USD	34		-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 197 \$)								\$	41
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -2.114 \$)									-1.422
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -1.917 \$)								\$	-1.381

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 56,65 % (28. Februar 2022: 54,78 %)		
Australien – 13,13 % (28. Februar 2022: 11,72 %)		
AUD	155 AGL Energy Ltd	2,87
AUD	74 APA Group	2,12
AUD	419 Aurizon Holdings Ltd	3,71
AUD	117 Transurban Group	4,43
		13,13
China – 13,32 % (28. Februar 2022: 11,69 %)		
HKD	526 China Merchants Port Holdings Co Ltd	2,94
HKD	4.854 China Tower Corp Ltd, 144A	2,10
HKD	1.322 Guangdong Investment Ltd	5,33
HKD	1.318 Yueshiu Transport Infrastructure Ltd	2,95
		13,32
Hongkong – 5,49 % (28. Februar 2022: 6,17 %)		
HKD	112 CLP Holdings Ltd	3,14
HKD	587 HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	1,50
HKD	39 Wharf Real Estate Investment Co Ltd	0,85
		5,49
Indien – 7,70 % (28. Februar 2022: 8,08 %)		
INR	1.635 NHPC Ltd	3,13
INR	428 Power Grid Corp of India Ltd	4,57
		7,70
Malaysia – 2,57 % (28. Februar 2022: 2,53 %)		
MYR	56 Petronas Gas Bhd	0,82
MYR	541 Westports Holdings Bhd	1,75
		2,57
Neuseeland – 5,98 % (28. Februar 2022: 2,83 %)		
NZD	166 Chorus Ltd	3,37
NZD	138 Contact Energy Ltd	2,61
		5,98
Philippinen – 1,10 % (28. Februar 2022: 3,60 %)		
PHP	48 Manila Electric Co	1,10
Singapur – 4,14 % (28. Februar 2022: 3,43 %)		
SGD	759 Capitaland India Trust	2,50
SGD	642 NETLINK NBN TRUST	1,64
		4,14
Thailand – 3,22 % (28. Februar 2022: 4,73 %)		
THB	2.156 Digital Telecommunications Infrastructure Fund	3,22
		56,65
Real Estate Investment Trusts – 42,58 % (28. Februar 2022: 44,07 %)		
Australien – 20,53 % (28. Februar 2022: 21,10 %)		
AUD	89 Charter Hall Long Wale REIT	1,09
AUD	416 Charter Hall Retail REIT	4,43
AUD	199 GPT Group/The	2,50
AUD	369 Region RE Ltd	2,51
AUD	637 Scentre Group	5,07
AUD	185 Stockland	1,90
AUD	555 Vicinity Ltd	3,03
		20,53
Hongkong – 8,91 % (28. Februar 2022: 6,65 %)		
HKD	1.213 Fortune Real Estate Investment Trust	4,08
HKD	185 Link REIT	4,83
		8,91
Indien – 4,22 % (28. Februar 2022: 5,04 %)		
INR	285 Embassy Office Parks REIT	4,22
Neuseeland – 2,04 % (28. Februar 2022: 1,31 %)		
NZD	893 Kiwi Property Group Ltd	2,04
Singapur – 6,88 % (28. Februar 2022: 9,97 %)		
SGD	635 CapitaLand Integrated Commercial Trust	3,62
SGD	119 Frasers Centrepoint Trust	0,79
SGD	355 Mapletree Industrial Trust	2,47
		6,88
		11,695 \$
		42,58

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Bezugsrechte – 0,14 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
Hongkong – 0,14 % (28. Februar 2022: 0,00 %)		
HKD	37 Link REIT ∞	0,14
		0,14
Summe Bezugsrechte (Anschaffungskosten – \$)		
	35	0,14
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 27.162 \$)		
	24.963	99,37
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2022: 0,04 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1	–
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	24.964	99,37
Devisenterminkontrakte – -0,07 % (28. Februar 2022: -0,04 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-19	-0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-19	-0,07
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	24.945	99,30
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	176	0,70
Gesamtneutrovermögen		
	25.121 \$	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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 529.000 \$ und machten 2,10 % des Nettovermögens aus.

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

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,80
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	1,20
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)	
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	17	Verkauf	AUD	25	\$	1
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	–	Verkauf	CNH	–		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	13	Verkauf	SGD	18		–
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	AUD	585	Verkauf	USD	406		-13
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	SGD	434	Verkauf	USD	328		-6
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	CNH	8	Verkauf	USD	1		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 11 \$)								\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -10 \$)									-19
Nettowertminderung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 1 \$)								\$	-18

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 99,55 % (28. Februar 2022: 99,59 %)			USA – 2,42 % (28. Februar 2022: 0,94 %)		
Brasilien – 6,02 % (28. Februar 2022: 5,07 %)			2 EPAM Systems Inc 521 1,50		
BRL	223 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	449 1,29	2 Globant SA 319 0,92		
BRL	190 Cosan SA	544 1,57	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 42.519 \$) 34.547 99,55		
BRL	141 Odontoprev SA	309 0,89	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 34.547 99,55		
BRL	105 WEG SA	787 2,27	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 34.547 99,55		
		2.089 6,02	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 155 0,45		
Chile – 2,16 % (28. Februar 2022: 1,89 %)			Gesamtvermögen 34.702 \$ 100,00		
GBP	40 Antofagasta Plc	751 2,16	– 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 %.		
China – 28,67 % (28. Februar 2022: 28,01 %)			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 2023 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.219.000 \$ und machten 3,52 % des Nettovermögens aus.		
HKD	55 Alibaba Group Holding Ltd	610 1,76	ABKÜRZUNGEN:		
HKD	8 Alibaba Group Holding Ltd ADR	660 1,90	– American Depositary Receipt		
HKD	82 Brilliance China Automotive Holdings Ltd	41 0,12	BRL – Brasilianischer Real		
HKD	132 China Merchants Bank Co Ltd	716 2,06	CNH – Chinesischer Renminbi		
CNH	11 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	608 1,75	– Britisches Pfund Sterling		
HKD	30 ENN Energy Holdings Ltd	431 1,24	HKD – Hongkong-Dollar		
HKD	4 JD.com Inc	82 0,24	IDR – Indonesische Rupiah		
HKD	12 JD.com Inc ADR	514 1,48	INR – Indische Rupie		
HKD	48 Meituan 'B', 144A	831 2,40	KRW – Südkoreanischer Won		
HKD	116 Minth Group Ltd	302 0,87	MXN – Mexikanischer Peso		
CNH	204 Ping An Bank Co Ltd	404 1,16	PHP – Philippinischer Peso		
HKD	124 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	844 2,43	SAR – Saudi-Arabischer Riyal		
HKD	121 Shanghai Fosun Pharmaceutical Group Co Ltd	354 1,02	TWD – Taiwanesischer Dollar		
CNH	36 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	379 1,09	Verteilung des Gesamtvermögens		
HKD	53 Tencent Holdings Ltd	2.343 6,75	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden 99,11		
HKD	56 Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	388 1,12	Sonstige Vermögenswerte 0,89		
CNH	27 Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd	166 0,48	Gesamtvermögen 100,00		
HKD	258 Xinyi Solar Holdings Ltd	276 0,80			
		9.949 28,67			
Hongkong – 2,94 % (28. Februar 2022: 2,35 %)					
HKD	96 AIA Group Ltd	1.020 2,94			
Indien – 17,02 % (28. Februar 2022: 17,91 %)					
INR	13 Asian Paints Ltd	430 1,24			
INR	47 HDFC Bank Ltd	915 2,64			
INR	127 ICICI Bank Ltd	1.313 3,78			
INR	27 Kotak Mahindra Bank Ltd	574 1,65			
INR	5 Maruti Suzuki India Ltd	499 1,44			
INR	35 Reliance Industries Ltd	967 2,79			
INR	29 Titan Co Ltd	820 2,36			
INR	4 UltraTech Cement Ltd	389 1,12			
		5.907 17,02			
Indonesien – 3,54 % (28. Februar 2022: 2,98 %)					
IDR	2.721 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	833 2,40			
IDR	1.552 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	396 1,14			
		1.229 3,54			
Mexiko – 4,57 % (28. Februar 2022: 0,77 %)					
MXN	81 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	686 1,98			
MXN	128 Orbia Advance Corp SAB de CV	266 0,76			
MXN	162 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	635 1,83			
		1.587 4,57			
Peru – 1,15 % (28. Februar 2022: 1,37 %)					
	3 Credicorp Ltd	397 1,15			
Philippinen – 0,43 % (28. Februar 2022: 0,42 %)					
PHP	150 Robinsons Retail Holdings Inc	148 0,43			
Saudi-Arabien – 1,78 % (28. Februar 2022: 2,36 %)					
SAR	33 Al Rajhi Bank	617 1,78			
Singapur – 0,47 % (28. Februar 2022: 0,00 %)					
	3 Sea Ltd ADR	164 0,47			
Südkorea – 15,91 % (28. Februar 2022: 18,76 %)					
KRW	1 LG Chem Ltd	738 2,13			
KRW	– LG Energy Solution Ltd	112 0,32			
KRW	– LG H&H Co Ltd	146 0,42			
KRW	2 NAVER Corp	314 0,90			
KRW	59 Samsung Electronics Co Ltd	2.709 7,81			
KRW	1 Samsung SDI Co Ltd	518 1,49			
KRW	15 SK Hynix Inc	985 2,84			
		5.522 15,91			
Taiwan – 12,47 % (28. Februar 2022: 14,15 %)					
TWD	55 Delta Electronics Inc	515 1,48			
TWD	40 Globalwafers Co Ltd	663 1,91			
TWD	190 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.149 9,08			
		4.327 12,47			

[^] 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 2023

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	Nettoinventarwert	% vom Gesamtvermögen	Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Stammaktien – 99,83 % (28. Februar 2022: 99,66 %)				Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,20
Dänemark – 3,76 % (28. Februar 2022: 4,42 %)				Finanzderivate	0,01
DKK 65 Coloplast A/S	7.103		3,76	Sonstige Vermögenswerte	3,79
Frankreich – 21,05 % (28. Februar 2022: 18,59 %)				Gesamtvermögen	100,00
210 Dassault Systemes SE	7.663		4,05		
16 Kering SA	8.777		4,64		
25 L'Oreal SA	9.278		4,91		
30 Pernod Ricard SA	5.913		3,13		
27 Sartorius Stedim Biotech	8.177		4,32		
	39.808		21,05		
Deutschland – 7,65 % (28. Februar 2022: 11,97 %)					
258 Infineon Technologies AG	8.629		4,56		
108 Nemetschek SE	5.835		3,09		
	14.464		7,65		
Irland – 6,83 % (28. Februar 2022: 7,86 %)					
60 Kerry Group Plc	5.445		2,88		
122 Kingspan Group Plc	7.478		3,95		
	12.923		6,83		
Italien – 15,71 % (28. Februar 2022: 11,91 %)					
76 Ferrari NV	18.590		9,83		
192 Moncler SpA	11.120		5,88		
	29.710		15,71		
Niederlande – 8,94 % (28. Februar 2022: 9,59 %)					
29 ASML Holding NV	16.902		8,94		
Schweden – 13,48 % (28. Februar 2022: 13,96 %)					
SEK 394 Assa Abloy AB	9.099		4,81		
SEK 728 Atlas Copco AB	8.185		4,33		
SEK 784 Hexagon AB	8.218		4,34		
	25.502		13,48		
Schweiz – 3,36 % (28. Februar 2022: 3,91 %)					
CHF 7 Partners Group Holding AG	6.353		3,36		
Vereinigtes Königreich – 12,44 % (28. Februar 2022: 11,91 %)					
559 Allfunds Group Plc	4.607		2,44		
59 Croda International Plc	4.373		2,31		
842 Dr Martens Plc	1.521		0,80		
28 Linde Plc	9.028		4,78		
1.681 Oxford Nanopore Technologies Plc	3.993		2,11		
	23.522		12,44		
USA – 6,61 % (28. Februar 2022: 5,54 %)					
USD 9 Mettler-Toledo International Inc	12.493		6,61		
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 217.476 €)	188.780		99,83		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 217.476 €)	188.780		99,83		
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2022: 0,09 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	22		0,01		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	188.802		99,84		
Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2022: -0,02 %)					
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-20		-0,01		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-20		-0,01		
Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	188.782		99,83		
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	315		0,17		
Gesamtvermögen	189.097 €		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 %.

ABKÜRZUNGEN:

CHF	– Schweizer Franken
DKK	– Dänische Krone
GBP	– Britisches Pfund Sterling
SEK	– Schwedische Kronen
USD	– US-Dollar

[^] 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 2023 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ (Wertminderung) von Kontrakten (in Tsd.)
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	74	Verkauf	BRL	411	€ -1
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2.287	Verkauf	BRL	12.551	20
2. März 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	12.962	Verkauf	EUR	2.340	2
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	USD	57	Verkauf	EUR	54	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	2	Verkauf	USD	2	-
15. März 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	1	Verkauf	USD	2	-
4. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf	EUR	24	Verkauf	BRL	135	-
4. Apr. 2023	BNY Mellon	Kauf	BRL	7.584	Verkauf	EUR	1.376	-19
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 281 €)							€	22
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): -69 €)								-20
Nettowertsteigerung von Devisenterminkontrakten (28. Februar 2022 (in Tsd.): 212 €)							€	2

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2023

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 92,33 %			Vereinigtes Königreich – 14,60 %		
Australien – 1,34 %			800 Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028 *	690	1,87
600 Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig 03.03.2028	492	1,34	700 easyJet FinCo BV, 1,875 %, fällig 03.03.2028	602	1,63
Belgien – 2,19 %			600 National Grid Plc, 0,163 %, fällig 20.01.2028	497	1,35
800 Crelan SA, 5,750 %, fällig 26.01.2028	806	2,19	800 Nationwide Building Society, 0,250 %, fällig 14.09.2028	645	1,75
China – 1,32 %			410 NatWest Markets Plc, 1,375 %, fällig 02.03.2027	367	1,00
600 Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	487	1,32	600 NatWest Markets Plc, 4,250 %, fällig 13.01.2028	596	1,62
Tschechische Republik – 1,77 %			700 Sage Group Plc/The, 3,820 %, fällig 15.02.2028	690	1,87
700 CEZ AS, 3,000 %, fällig 05.06.2028	652	1,77	400 Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig 25.08.2028 *	380	1,03
Dänemark – 1,57 %			800 Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, fällig 31.01.2028	680	1,85
700 Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, fällig 17.01.2028	577	1,57	280 Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	230	0,63
Finnland – 1,55 %				5.377	14,60
700 OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig 16.06.2028	572	1,55	USA – 14,75 %		
Frankreich – 16,09 %			500 Apple Inc, 2,000 %, fällig 17.09.2027	470	1,28
320 Altice France SA/France, 3,375 %, fällig 15.01.2028	247	0,67	600 Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig 15.07.2028	551	1,49
800 BPCE SA, 4,375 %, fällig 13.07.2028	792	2,15	640 Berry Global Inc, 1,500 %, fällig 15.01.2027	570	1,55
400 CAB SELAS, 3,375 %, fällig 01.02.2028	324	0,88	450 DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027	374	1,01
800 Engie SA, 1,750 %, fällig 27.03.2028	724	1,97	650 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 22.03.2028	587	1,59
320 Iliad Holding SASU, 5,625 %, fällig 15.10.2028	295	0,80	600 International Business Machines Corp, 0,300 %, fällig 11.02.2028	506	1,38
300 Iliad SA, 1,875 %, fällig 11.02.2028	248	0,67	500 IQVIA Inc, 2,250 %, fällig 15.01.2028	430	1,17
800 La Banque Postale SA, 1,000 %, fällig 09.02.2028 *	694	1,89	700 JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig 18.05.2028 *	629	1,71
800 Orano SA, 2,750 %, fällig 08.03.2028	730	1,98	800 Morgan Stanley, 4,813 %, fällig 25.10.2028 *	810	2,20
600 RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	602	1,64	540 PVH Corp, 3,125 %, fällig 15.12.2027	504	1,37
500 Rexel SA, 2,125 %, fällig 15.12.2028	433	1,18		5.431	14,75
400 SANEF SA, 0,950 %, fällig 19.10.2028	336	0,91	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 34.720 €)		
600 Societe Generale SA, 0,125 %, fällig 18.02.2028	498	1,35		33.997	92,33
	5.923	16,09	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 2,07 %		
Deutschland – 3,54 %			Rumänien – 2,07 %		
700 Commerzbank AG, 4,625 %, fällig 21.03.2028 *	694	1,89	900 Internationale Anleihe der rumänischen Regierung, 2,125 %, fällig 07.03.2028	762	2,07
700 Vonovia Finance BV, 1,500 %, fällig 14.01.2028	609	1,65	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 777 €)		
	1.303	3,54		762	2,07
Griechenland – 0,68 %			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
300 Eurobank SA, 2,250 %, fällig 14.03.2028 *	252	0,68		34.759	94,40
Irland – 3,05 %			Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
800 AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028 *	724	1,96		34.759	94,40
400 Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028 *	400	1,09	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	1.124	3,05		2.064	5,60
Italien – 7,49 %			Gesamtvermögen		
800 Atlantia SpA, 1,875 %, fällig 12.02.2028	678	1,84		36.823 €	100,00
500 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	426	1,16	– 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 %.		
400 Autostrade per l'Italia SpA, 2,000 %, fällig 04.12.2028	338	0,92	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2023.		
350 IMA Industria Macchine Automatiche SpA, 3,750 %, fällig 15.01.2028	306	0,83	Verteilung des Gesamtvermögens		
800 Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig 20.03.2028	702	1,90	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
300 Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, fällig 06.02.2028	309	0,84	Sonstige Vermögenswerte		
	2.759	7,49	Gesamtvermögen		
			100,00		
Luxemburg – 3,14 %			Niederlande – 2,14 %		
600 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, fällig 04.05.2028	446	1,21	800 ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, fällig 16.01.2028	787	2,14
300 Kleopatra Finco Sarl, 4,250 %, fällig 01.03.2026	254	0,69	Portugal – 2,24 %		
500 Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig 15.11.2027	457	1,24	800 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig 31.10.2028 *	824	2,24
	1.157	3,14	Spanien – 9,71 %		
Niederlande – 2,14 %			700 Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, fällig 14.09.2028 *	694	1,88
Portugal – 2,24 %			400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, fällig 01.02.2028	322	0,87
800 Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig 31.10.2028 *	824	2,24	700 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig 07.02.2029 *	684	1,86
Spanien – 9,71 %			600 Banco Santander SA, 3,875 %, fällig 16.01.2028	590	1,60
700 Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, fällig 14.09.2028 *	694	1,88	800 CaixaBank SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028 *	681	1,85
400 Arena Luxembourg Finance Sarl, 1,875 %, fällig 01.02.2028	322	0,87	600 Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027 *	606	1,65
700 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig 07.02.2029 *	684	1,86		3.577	9,71
600 Banco Santander SA, 3,875 %, fällig 16.01.2028	590	1,60	Schweden – 2,67 %		
800 CaixaBank SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028 *	681	1,85	400 SBB Treasury Oyj, 0,750 %, fällig 14.12.2028	264	0,72
600 Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027 *	606	1,65	400 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027	399	1,08
	3.577	9,71	300 Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig 15.10.2027	318	0,87
Schweden – 2,67 %				981	2,67
400 SBB Treasury Oyj, 0,750 %, fällig 14.12.2028	264	0,72	Schweiz – 2,49 %		
400 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027	399	1,08	430 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	379	1,03
300 Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig 15.10.2027	318	0,87	700 Credit Suisse Group AG, 0,650 %, fällig 14.01.2028 *	537	1,46
	981	2,67		916	2,49
Schweiz – 2,49 %					
430 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	379	1,03			
700 Credit Suisse Group AG, 0,650 %, fällig 14.01.2028 *	537	1,46			
	916	2,49			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Bilanz

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1	\$ 1	\$ –	\$ 16	\$ 34.310	\$ 20.859	€ 4.251	€ 1.027
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	2.060	4.462	7.065	18.123	2.191	2.338
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	844.196	939.444	140.166	234.866	1.183.129	1.477.772	125.838	146.614
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	280	–	–
Optionen	–	–	64	58	556	383	4	–
Swapkontrakte	–	–	2.534	2.494	8.276	11.755	–	72
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	540	3.409	72	59
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	303	726	2.474	5.952	476	567
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	1.429	2.086	17.093	14.432	–	3
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	53	153	429	948	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	2.036	313	1.107	1.348	8.995	8.588	1.280	1.156
Dividendenforderungen	–	–	8	3	10	8	31	28
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	1
Gesamtumlaufermögen	846.233	939.758	147.724	246.212	1.262.877	1.562.509	134.143	151.865
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	620	659	849	1.199	–	–
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	2.826	2.642	445	2.114	9	508
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	70	229	615	1.476	4	3
Swapkontrakte	–	–	46	421	1.867	3.508	–	743
Swaptions	–	–	–	–	–	258	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	50	2.578	7.304	338	569
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	180	1.522	3.625	8.964	1.065	590
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	9.879	19.972	11.726	5.654	101.191	44.980	187	1
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	2.054	6	132	55	148	48	1	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	363	55	71	141	487	668	3	2
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	24	22	16	17	73	78	14	10
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	1	16	20	31	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1	1.814	1.904	3.508	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	298	379	116	86	375	283	55	52
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	12.618	20.434	15.805	13.306	114.177	74.419	1.676	2.479
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 833.615	\$ 919.324	\$ 131.919	\$ 232.906	\$ 1148700	\$ 1488090	€ 132467	€ 149386
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^µ								
(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 ^µ	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 3.850	\$ 5.997	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 45	\$ 776
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	162	168	–	–	–	–	–	993
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	52.716	75.783	–	–	–	–	–	57.903
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	26
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	60	193	–	–	–	–	–	353
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	38	51	–	–	–	–	–	315
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	554	466	–	–	–	–	–	1
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	4	37	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	739	846	–	–	–	–	–	214
Dividendenforderungen	–	5	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	1
Gesamtumlaufermögen	58.123	83.546	14	14	17	17	45	60.582
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	140	–	–	–	–	–	–	–
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	38	51	–	–	–	–	–	181
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	2
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	286
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	271	139	–	–	–	–	–	298
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	236
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	4	158	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	89	29	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	41	72	–	–	–	–	–	9
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	11	9	–	5	–	2	3	7
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	4	8	–	–	–	–	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	1.011	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	94	91	14	9	17	15	42	37
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	692	1.568	14	14	17	17	45	1.057
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 57.431	\$ 81.978	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 59.525

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^τ		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{Δδ}		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^{Δβ}	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 1.425	\$ 2.087	\$ 20.391	\$ 14.249	\$ 63	\$ 5	\$ 60	\$ 3.396	\$ 35	\$ 459
–	5	882	3447	1126	1.156	–	318	–	88
–	50.718	20.2891	283.356	123.407	255.876	–	37.277	–	27.090
–	–	–	89	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	9	–	9
–	–	–	–	102	112	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1	775	4.595	1	–	–	155	–	–
–	–	74	104	–	47	–	–	–	1
–	167	4.780	1.435	608	4.839	–	–	–	–
–	170	28	23	8	347	–	–	–	–
–	707	2.851	2.987	1.920	3.416	–	460	–	347
–	–	15	–	5	2	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	–	–	–	–	–	2	–	–	–
1.426	53.855	232.687	310.285	127.240	265.800	62	41.615	35	27.994
–	–	559	–	155	578	–	–	–	–
–	–	27	330	–	190	–	127	–	–
–	–	–	–	–	–	–	6	–	–
–	–	–	657	116	19	–	8	–	–
–	29	4.011	2.265	35	41	–	174	–	39
–	–	29	1.281	31	72	–	89	–	27
–	214	266	42	1.250	341	–	–	–	–
12	16	94	28	172	59	–	3	–	–
14	49	91	114	67	119	–	18	–	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
9	24	20	20	14	18	3	19	3	6
2	5	6	7	7	9	–	1	–	–
1.366	488	45	2.408	74	5.179	11	10	–	44
23	38	184	164	79	75	48	42	32	29
1.426	863	5.332	7.316	2.000	6.700	62	497	35	146
\$ –	\$ 52.992	\$ 227.355	\$ 302.969	\$ 125.240	\$ 259.100	\$ –	\$ 41.118	\$ –	\$ 27.848
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^Δ		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^{Δβ}	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 998	\$ 3.674	\$ 3.559	\$ 3.114	\$ 47.35	\$ 3.512	\$ 743	\$ 418	€ 31	€ 4.275
1.540	2.793	2.733	1.944	1.544	4.353	1.074	1.374	–	223
433.473	492.770	532.162	445.353	146.874	199.783	43.765	74.454	–	32.770
–	–	–	–	152	314	–	–	–	–
–	–	–	–	19	–	–	–	–	–
–	7.755	213	–	–	142	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
162	378	3.707	4.176	1.011	1.797	343	827	–	8
–	–	4.839	2.194	338	837	202	437	–	–
771	120	2.646	5.009	3.576	3.851	1	3	–	–
41	122	2.043	392	1	2	1	4	–	–
4.375	6.174	2.855	2.276	1.086	1.218	491	800	–	431
20	2	127	4	15	41	6	9	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	1	–	–	–	–	–	–	–
441.380	513.788	554.885	464.462	159.351	215.850	46.626	78.326	31	37.707
522	–	484	161	–	5	–	9	–	–
6	–	1	1.642	17	777	3	339	–	–
–	–	–	–	4	8	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1.508	76	393	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.130	594	3.219	4.645	2.097	1.907	90	116	–	66
373	1.113	61	181	1.043	1.170	34	44	–	–
770	120	25.758	5.838	9.282	3.922	306	3	–	140
15	7	2	–	–	–	–	–	–	–
200	241	153	137	17	32	2	2	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
32	30	36	26	15	15	9	9	3	5
13	19	11	10	–	–	–	–	–	–
299	1.467	1.106	7.487	72	3467	–	5	–	–
313	403	84	86	101	91	56	53	28	48
3.673	3.994	30.915	20.213	12.648	12.902	576	973	31	259
\$ 437.707	\$ 509.794	\$ 523.970	\$ 444.249	\$ 146.703	\$ 202.948	\$ 46.050	\$ 77.353	€ –	€ 37.448

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 63.691	\$ 104.039	\$ 30	\$ 30	\$ 3.203	\$ 9.344	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	250.586	717.419	–	–	3.915	4.542	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	1.913.653	3.826.412	–	–	267.865	358.203	–	–
Verpfändete Anlagen	1.590	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	6.090	28.173	–	–	566	382	–	–
Swapkontrakte	155.867	227.706	–	–	1.033	207	–	–
Swaptions	–	7	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	21.504	112.006	–	–	536	5.345	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	20.467	213.705	–	–	53	774	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	13.260	9.667	–	–	5.180	2.208	–	–
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	1.024	7.091	–	–	2.133	2	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	36.399	54.650	–	–	3.427	3.647	–	–
Dividendenforderungen	487	3	–	–	8	9	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	1	1.002	–	–
Gesamtumlaufvermögen	2.484.618	5.300.878	30	30	287.920	385.665	–	–
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	83.849	101.514	–	–	2	–	–	–
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	76.579	266.033	–	–	119	836	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	46.352	127.700	–	–	36	177	–	–
Swapkontrakte	43.002	239.384	–	–	761	572	–	–
Swaptions	–	528	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	43.616	98.156	–	–	2.965	7.240	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	47.194	237.864	–	–	890	2.239	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	4.384	14.790	–	–	7.800	2.415	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	2.062	4.149	–	–	24	27	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	151	243	–	5	22	22	–	–
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	136	279	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3.140	23.005	–	–	82	61	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.652	3.399	30	25	207	177	–	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	352.117	1.117.044	30	30	12908	13.766	–	–
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 2.132.501	\$ 4.183.834	\$ –	\$ –	\$ 275.012	\$ 371.899	\$ –	\$ –
(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 136	\$ 47	\$ 223	\$ 210	\$ 1.762	\$ 13.991	\$ 5	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	194	43	–	101	2.709	14.317	8	22
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	8.571	9.435	164.330	215.108	538.707	728.758	10.360	11.416
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	97
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	92	270	3.132	4.267	13.024	21.946	10	50
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	59	21	–	–	2.190	1.272	2	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	155	–	490	230	1.798	–	248	–
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	117	163	1.797	3	1	–
Zinsen und sonstige Erträge	104	94	1.781	1.992	5.523	4.812	175	179
Dividendenforderungen	1	2	345	754	233	319	2	1
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	2	13	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	8	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	9.322	9.925	170.418	222.825	567.743	785.418	10.811	11.765
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	4	3	7	13	–	1
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	26	5	850	1.190	2.495	5.014	–	90
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	12
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	107	26	3.966	4.493	23.627	22.185	202	20
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	5	–	–	–	–	4.865	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	145	–	490	230	1.798	–	163	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	1	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	83	124	260	150	–	2
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	13	5	24	16	38	42	7	5
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	11	18	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	2.595	638	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	31	23	386	478	247	431	44	45
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	327	59	8.409	7.190	28.472	32.700	417	175
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 8.995	\$ 9.866	\$ 16.209	\$ 21.5635	\$ 539.271	\$ 752.718	\$ 10.394	\$ 11.590

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 1.723 629	\$ 1.313 3.553	\$ 416 4.167	\$ 112 6.058	£ 1.256 297	£ 2.378 154	\$ 1.005 978	\$ 293 564	\$ 136 541	\$ 222 1.344
557.051	1.054.614	1.148.337	1.283.066	43.921	70.140	94.192	174.022	17.280	21.064
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1.058	-	1.296	-	-	-	-	19	5
-	2.784	-	-	-	-	-	-	899	453
8	203	-	-	27	8	35	143	11	120
317	502	353	1.640	45	59	4	202	156	191
-	-	46.919	55.814	-	-	-	788	99	15
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.998	2.369	4.402	3.603	686	982	1.007	1.417	173	126
45	3	5	1	-	3	8	2	5	-
-	-	-	-	-	-	-	-	4	7
-	1	-	2	1	-	-	-	1	-
561.771	1.066.400	1.204.599	1.351.592	46.233	73.724	97.229	177.431	19.324	23.547
-	-	878	189	-	-	-	10	-	-
-	380	54	2.408	-	-	6	280	389	-
-	-	-	-	-	-	-	-	38	81
-	592	-	-	-	-	74	-	2	68
-	1.269	-	-	-	-	-	-	-	-
1.683	3.513	-	14	7	35	404	1.739	58	189
73	2.083	731	666	29	10	103	158	120	533
-	-	83.125	200.768	229	-	1.787	-	193	661
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
77	255	13	-	-	-	4	5	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	56	69	60	11	7	12	13	31	17
2	2	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
350	309	222	207	45	39	64	57	52	40
2.223	8.459	85.092	204.312	321	91	2.454	2.262	883	1.589
\$ 559.548	\$ 1.057.941	\$ 1.119.507	\$ 1.147.280	£ 45.912	£ 73.633	\$ 94.775	\$ 175.169	\$ 18.441	\$ 21.958
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund^		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 422 -	\$ 420 351	\$ 2.173 -	\$ 246 -	\$ 32.149 25.134	\$ 3 14.599	\$ - 980	\$ - 571	\$ - -	\$ - 20
204.726	242.628	-	-	1.153.805	1.522.073	45.793	51.853	8.488	10.165
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	1.309	22.750	-	154	-	80
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.448	2.854	-	-	3.510	9.078	403	79	-	-
-	-	-	-	-	-	69	86	-	-
9.346	-	-	-	838	120.110	-	-	134	-
-	3	-	-	2.452	2.047	-	-	-	-
2.543	2.266	-	-	15.517	14.572	215	335	137	149
601	866	-	-	337	10	11	-	2	-
-	-	-	7	-	-	-	-	21	-
-	-	-	-	8	7	1	-	-	-
219.086	249.388	2.173	253	1.235.059	1.705.249	47.472	53.078	8.782	10.414
3	4	-	-	1	10.850	-	325	103	-
110	610	-	-	-	2.390	-	20	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	878	-	37	-	-	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.239	4.074	-	-	12.389	17.153	379	145	192	196
-	-	-	-	3.704	1.309	175	81	-	-
9.308	-	-	-	5.978	61.079	-	-	30	-
-	-	-	-	106	37	-	-	-	-
100	119	-	-	701	998	39	46	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	17	-	-	77	83	20	7	7	5
1	1	-	-	78	107	-	1	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	1	-	-	714	3.099	-	-	-	-
148	166	2.173	253	128	71	66	67	60	38
13.940	4.992	2.173	253	24.754	971.76	716	692	393	251
\$ 205.146	\$ 244.396	\$ -	\$ -	\$ 1.210.305	\$ 1.608.073	\$ 46.756	\$ 52.386	\$ 8.389	\$ 10.163

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ -	\$ -	\$ 1.879	\$ 1.406	\$ 1.147	\$ -	\$ -	\$ -
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	-	-	664	2.861	431	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	-	-	69.694	100.896	13.130	-	2.583	2.236
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	33	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	-	-	249	3.520	86	-	-	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	1.151	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	-	-	327	508	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Zinsen und sonstige Erträge	-	-	948	1.093	186	-	-	-
Dividendenforderungen	-	-	9	50	-	-	5	1
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	-	-	-	-	5	-	23	2
Sonstige Vermögenswerte	-	-	-	-	4	-	-	-
Gesamtumlautvermögen	-	-	73.770	111.485	15.022	-	2.611	2.240
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	-	-	1	2	-	-	-	-
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	-	-	122	630	-	-	-	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	-	-	3.482	4.556	64	-	20	29
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	283	1.426	123	-	-	-
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	-	-	327	508	-	-	-	-
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	-	-	-	5	-	-	-	-
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	-	-	13	12	4	-	7	5
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	-	-	132	115	27	-	50	29
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	-	-	4.360	7.254	218	-	77	63
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ -	\$ -	\$ 69.410	\$ 104.231	\$ 14.804	\$ -	\$.2534	\$ 2.177

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
	UMLAUFVERMÖGEN:							
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 11.596	\$ 6.591	\$ 2.053	\$ 1.384	\$ 11.074	\$ 2	\$ 385	\$ 246
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	-	-	-	-	-	-	-	-
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	214.039	536.471	36.590	42.210	1.629.033	1.618.990	12.823	14.292
Verpfändete Anlagen	-	-	-	-	-	-	-	-
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	4	113	1	20	22	145	-	-
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	179	445	-	-	3.682	1.602	-	-
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	5	111	-	36	29.209	4.006	-	1.500
Zinsen und sonstige Erträge	14	-	7	6	20	-	-	-
Dividendenforderungen	42	83	72	65	740	840	13	13
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	-	-	-	-	-	-	-	-
Sonstige Vermögenswerte	-	-	-	-	4	1	-	-
Gesamtumlautvermögen	225.879	543.814	38.723	43.721	1.673.784	1.625.586	13.221	16.051
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	-	397	-	-	7	8.610	-	-
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	-	-	-	-	-	-	-	-
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	-	-	-	-	-	-	-	-
Swapkontrakte	-	-	-	-	-	-	-	-
Swaptions	-	-	-	-	-	-	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	229	123	56	38	840	2.099	-	-
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	179	2.179	-	207	3.682	1.602	-	-
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	-	-	-	-	-	-	-	-
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	200	391	33	38	704	694	6	7
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	-	-	-	-	-	-	-	-
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	43	61	11	8	130	106	9	6
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	35	50	4	5	170	108	-	-
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	176	2.136	44	100	28.161	12.990	-	-
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	224	318	47	46	111	62	27	20
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	1.086	5.655	195	442	33.805	26.271	42	33
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 224.793	\$ 538.159	\$ 38.528	\$ 43.279	\$ 1.639.979	\$ 1.599.315	\$ 13.179	\$ 16.018

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 12.361	\$ 10.821	\$ 59	\$ 58	\$ 55	\$ 57	\$ 9.110	\$ 18.115	\$ 54.486	\$ 30.686
-	-	-	-	-	-	-	-	530	-
921.986	881.788	-	-	-	-	180.681	207.470	1.172.787	1.756.332
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
10	14	-	-	-	-	-	-	286	4.603
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4.380	304	-	-	-	-	43	-	2.355	6.645
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
724	871	-	-	-	-	-	3	1.211	2.327
72	-	-	-	-	-	10	-	67	-
989	887	-	-	-	-	160	193	1.120	1.081
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	-	-	-	-	-	-	-	-
940.524	894.685	59	58	55	57	190.004	225.781	1.232.842	1801674
2.030	1	-	-	-	-	-	-	5	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	4.240
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
976	641	-	-	-	-	-	-	1.551	1.709
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.635	304	-	-	-	-	43	-	429	1.938
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
609	567	-	-	-	-	165	196	795	1.137
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
86	67	-	-	-	5	27	23	165	158
56	56	-	-	-	-	23	31	109	148
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
288	701	29	29	-	-	55	11.979	3.685	19.322
118	110	30	29	55	52	81	72	368	326
10.798	2.447	59	58	55	57	394	12.301	7.107	28.979
\$ 929.726	\$ 892.238	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 189.610	\$ 213.480	\$1.225.735	\$1.772.695
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^] _€		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
€ 25.979	€ 13.373	\$ 50	\$ 75	\$ 8.169	\$ 6.456	\$ 1	\$ 93	\$ -	\$ 12
-	-	-	-	-	-	330	-	-	-
1.032.510	648.298	-	2.667	399.290	164.133	744.113	933.530	78.654	88.460
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.921	3.195	-	-	24	82	150	1.468	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3.932	961	-	-	3.321	3.945	1.897	13.964	144	293
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.238	8.689	-	-	1.858	1.113	711	1.026	1	35
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.740	1.626	-	7	2.085	725	474	323	16	10
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	-	-	-	14	-	-	-	1	-
1.068.323	676.142	50	2.749	414.761	176.454	747.676	950.404	78.816	88.811
2	2	-	-	6	14	643	56	142	341
-	340	-	-	-	-	-	1.170	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.058	438	-	30	2.229	332	1.623	1.791	2	5
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2.286	1.204	-	-	3.872	2.075	1.944	14.230	358	99
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
826	549	-	2	377	186	624	747	83	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
103	53	3	5	31	14	82	68	16	12
99	69	-	-	74	42	109	130	12	15
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.022	1.968	-	-	2.062	368	915	15.803	37	249
94	95	47	47	62	29	207	200	68	64
5.490	4.718	50	84	8.713	3.060	6.147	34.195	718	876
€1.062.833	€ 671.424	\$ -	\$ 2.665	\$ 406.048	\$ 173.394	\$ 741.529	\$ 916.209	\$ 78.098	\$ 87.935

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] γ		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ –	\$ –	\$ 23	\$ 23	€ 1.256	€ 304	\$ 402	\$ 69
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	4.273	4.550	–	–	–	27.834	20.883	25.897
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	162	–	34
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	6	–	–	–	52	–	539
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	52	3	3
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	1	–
Dividendenforderungen	8	3	–	–	3	172	62	123
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	5	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	4.281	4.564	23	23	1.259	28.576	21.351	26.665
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	182
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	23	90	139
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	5	–	–	–	51	–	214
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1	–	–	–	–	29	25	30
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	7	4	–	–	3	5	11	8
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	3	2	5
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	1.185	49	–	20
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	19	21	23	23	71	79	133	184
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	27	30	23	23	1259	239	261	782
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 4.254	\$ 4.534	\$ –	\$ –	€ –	€ 28.337	\$ 21.090	\$ 25.883
(in Tsd.)	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 [^]	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 28	\$ 28	€ 65	€ 76	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	28	28	65	76	51	51	61	61
KURZFRISTIGE PASSIVA:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	3	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	4	–	3	–	–	–	3
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	51	51	38	38
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	28	24	65	70	–	–	23	20
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	28	28	65	76	51	51	61	61
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^{^α}		Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long- Term Unconstrained Fund [^]	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 60	\$ 60	\$ 41	\$ 56	\$ 2.569	\$ 132	¥ 114.974	¥ 97.595	\$ 12	\$ 702
-	-	-	-	-	123.72	-	-	3.598	15.463
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	7	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.100	-	-	-	-
-	-	-	-	-	34	-	-	14	52
-	-	-	-	-	-	-	-	4	-
60	60	41	56	2.569	13.645	114.974	97.595	3.628	16.217
-	-	-	-	-	5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.033	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12	-	-	2	12
-	-	-	-	4	6	-	-	14	11
59	59	2	1	2.516	-	-	-	-	-
1	1	39	55	49	45	114.974	97.595	74	76
60	60	41	56	2.569	1.102	114.974	97.595	90	99
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 12.543	¥ -	¥ -	\$ 3.538	\$ 16.118
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 ^{^π}	
Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
\$ 87	\$ 1.270	\$ 156	\$ 433	\$ 174	\$ 836	€ 780	€ 1.581	€ 1.848	€ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
142.529	170.458	24.963	27.613	34.547	47.639	188.780	302.551	34.759	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
41	197	1	11	-	-	22	281	-	-
154	19.017	-	141	-	-	4.857	86	-	-
85	2.453	-	-	104	10	1.732	26	689	-
61	46	145	197	31	56	57	36	344	-
-	-	-	-	-	-	-	-	11	-
-	-	-	-	-	-	-	-	9	-
-	-	-	-	-	-	1	-	2	-
142.957	193.441	25.265	28.395	34.856	48.541	196.229	304.561	37.662	-
-	-	-	-	-	-	3	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.422	2.114	19	10	-	-	20	69	-	-
154	6.577	-	280	-	-	4.372	86	815	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
76	105	18	19	26	36	55	99	-	-
19	17	9	6	11	9	41	34	2	-
8	12	3	5	1	2	1	2	-	-
184	15.197	-	-	-	443	2.603	662	-	-
45	38	95	141	116	213	37	19	22	-
1.908	24.060	144	461	154	703	7.132	971	839	-
\$ 141.049	\$ 169.381	\$ 25.121	\$ 27.934	\$ 34.702	\$ 47.838	€ 189.097	€ 303.590	€ 36.823	€ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
UMLAUFVERMÖGEN:		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 331.948	\$ 295.765
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	312.657	808.667
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):		
Anlagen	17.052.700	22.173.582
Verpfändete Anlagen	1.742	683
Optionen	7.318	29.019
Swapkontrakte	170.266	276.166
Swaptions	–	2.791
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	53.350	186.626
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	32.496	230.923
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	135.703	269.885
Forderungen aus verkauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	48.971	35.931
Zinsen und sonstige Erträge	103.724	124.101
Dividendenforderungen	10.290	8.925
Forderungen aus Verwaltungsgebühren	64	34
Sonstige Vermögenswerte	59	1.015
Gesamtumlaufvermögen	18.261.288	24.444.113
KURZFRISTIGE PASSIVA:		
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	91.015	125.131
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung (Erläuterung 8)	84.123	294.640
Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):		
Optionen	47.119	129.683
Swapkontrakte	46.859	248.273
Swaptions	–	2.055
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	121.367	191.714
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	59.938	266.598
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	301.633	394.100
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	2.826	288
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	9.548	12.569
Zahlbare Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	3
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	1.695	1.654
Fällige Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.005	1.208
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	54.803	136.182
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	11.327	11.337
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist)	833.258	1.815.435
Summe des auf die Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens	\$ 17.428.030	\$ 22.628.678

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

Die Euro-Beträge für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9454 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8919).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Japan Equity Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum USD/JPY-Schlusskurs von 136,1550 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 114,9650).

Die Pfund Sterling-Beträge für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,8314 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7454).

Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

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

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

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

δ Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

ε Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.

π Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.

τ Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied
30. Juni 2023

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2023			28. Februar 2022			28. Februar 2021		
	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 Global Emerging Markets Fund[^] (Fortsetzung)									
Klasse X USD thesaurierend	\$ 2	–	96,38	\$ 656	6	116,89	\$ 801	6	142,84
Klasse Premier USD, thesaurierend	3.812	39	98,17	6.709	57	118,63	7.740	54	144,46
Klasse S USD, thesaurierend	347	3	119,33	2.252	16	143,91	3.225	18	174,89
Klasse S EUR, thesaurierend	10.563	94	105,77	18.633	138	120,24	22.120	135	135,80
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]									
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	€ 26	–	80,63	€ 39	1	86,53	€ –	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend	1.770	13	136,40	7.094	47	151,56	869	6	148,44
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	26	–	79,81	38	1	86,29	–	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend	528	4	140,86	1.877	12	155,36	661	4	151,02
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1.342	76	97,67	3.184	191	96,48	–	–	–
Klasse Premier EUR, thesaurierend	850	6	143,00	26.577	169	157,16	17.885	117	152,24
Klasse S USD, thesaurierend	1	–	108,31	–	–	–	87.876	1.077	98,43
Klasse S EUR, thesaurierend	76.234	609	125,11	145.601	1063	136,96	4.080	31	132,14
Klasse S GBP, thesaurierend	108.320	1.267	75,17	119.180	1273	78,23	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund^{^;π}									
Klasse A EUR, thesaurierend	€ 98	1	98,13	€ –	–	–	€ –	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	5.022	51	98,18	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus	98	1	98,13	–	–	–	–	–	–
Klasse D EUR, thesaurierend	98	1	98,08	–	–	–	–	–	–
Klasse D EUR, ausschüttend (A)	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	9.474	97	98,17	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR, ausschüttend (A)	21.739	221	98,22	–	–	–	–	–	–

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

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

Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

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

α Mit Wirkung vom 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

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

δ Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

ε Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.

π Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.

τ Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Gesamtergebnisrechnung

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022						
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 19.590	\$ 736	\$ 5.896	\$ 6.898	\$ 49.800	\$ 44.481	€ 2.399	€ 1.475
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	6	–	1	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	-1	-3	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-23.862	-3.097	-121.262	-9.356	-6.318	204
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-6.884	-11.691	-109.818	-91.080	-18.592	-6.334
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	19.590	736	-24.850	-7.890	-181.275	-55.958	-22.510	-4.655
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	4.894	5.262	12.00	2.110	7.092	9.504	35	33
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	223	236	129	168	944	939	103	77
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	149	232	309	539	2	2
Anwaltsgebühren	3	21	5	3	38	21	3	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	17	20	35	41	35	41	24	24
Druckgebühren	54	45	15	25	87	137	9	9
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	12	22	7	26
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	7	5	1	2	10	9	1	1
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	85	92	148	54	520	268	29	24
Gesamtaufwendungen	5.283	5.681	1.682	2.635	9.047	11.480	213	197
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-645	-5.036	-51	–	-15	–	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	4.638	645	1631	2635	9032	11480	213	197
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	14.952	91	-26.481	-10.525	-190.307	-67.438	-22.723	-4.852
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-11.932	-76	-1.859	-1.567	-2.917	-2.649	-8	-1
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	3.020	15	-28.340	-12.092	-193.224	-70.087	-22.731	-4.853
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	4	–	-236	-113	2	-10
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 3.020	\$ 15	\$ -28.336	\$ -12.092	\$ -193.460	\$ -70.200	€ -22.729	€ -4.863

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund		Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^A		Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund ^A		Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund ^{A,µ}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 4.211	\$ 4.886	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.736	\$ 2.111
Zinsen (Erläuterung 2)	1	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	-2	–	–	–	–	–	-7
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	1	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-4.968	2.674	–	–	–	–	-3.715	2.482
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-6.290	-10.546	–	–	–	–	-1.106	-1.994
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-7.046	-2.988	–	–	–	1	-3.085	2.592
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	604	1.062	–	–	–	–	76	82
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	52	64	–	–	–	–	18	37
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	80	110	–	–	–	–	10	12
Anwaltsgebühren	1	1	–	–	–	–	1	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	22	17	–	–	–	–	13	25
Druckgebühren	6	9	–	–	–	–	4	4
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	1	–	–	–	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	1	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	1	–	–
Sonstige Aufwendungen	43	26	–	–	–	–	35	16
Gesamtaufwendungen	809	1.290	–	–	–	1	157	177
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-21	–	–	–	–	–	-32	-1
Nettoaufwendungen insgesamt	788	1.290	–	–	–	1	125	176
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-7.834	-4.278	–	–	–	–	-3.210	2.416
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-2.507	-2.633	–	–	–	–	-153	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	-10.341	-6.911	–	–	–	–	-3.363	2.416
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	-40	-11	–	–	–	–	2	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -10.381	\$ -6.922	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -3.361	\$ 2.416

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 ^{△β}	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 2.290	\$ 2.171	\$ 1.2184	\$ 17.245	\$ 12.690	\$ 13.541	\$ 1.115	\$ 1703	\$ 357	\$ 1.685
-	-	3	1	-	1	-	-	-	-
-	-	-1	11	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-5.513	729	-18.028	16.567	-26.636	2.039	-9.246	-608	-5.081	667
1.341	-2.290	-29.851	-43.376	-8.685	-13.880	4.275	-5.119	2.932	-5.238
-1.882	610	-35.693	-9.552	-22.631	1.701	-3.856	-4.024	-1.792	-2.886
418	557	1.174	1.839	1.053	1.637	121	290	2	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
34	35	175	260	132	157	20	31	7	28
46	55	79	124	103	142	8	20	-	-
1	1	7	6	6	3	-	-	-	1
11	27	35	41	22	17	12	20	10	17
4	4	19	37	14	21	3	3	1	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	3	8	3	2	-	-	-	-
-	-	1	4	1	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	15	80	83	72	47	25	14	10	12
541	694	1.573	2.402	1.406	2.027	189	378	30	74
-24	-11	-1	-	-10	-	-14	-8	-17	-
517	683	1.572	2.402	1.396	2.027	175	370	13	74
-2.399	-73	-37.265	-11.954	-24.027	-326	-4.031	-4.394	-1.805	-2.960
-533	-499	-4.900	-6.202	-3.795	-2.869	-826	-928	-319	-1.525
-2.932	-572	-42.165	-18.156	-27.822	-3.195	-4.857	-5.322	-2.124	-4.485
-1	-3	-183	-241	-77	-42	1	-12	10	1
\$ -2.933	\$ -575	\$ -42.348	\$ -18.397	\$ -27.899	\$ -3.237	\$ -4.856	\$ -5.334	\$ -2.114	\$ -4.484
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 ^{△β}	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 18.250	\$ 22.129	\$ 6.684	\$ 5.461	\$ 4.665	\$ 4.977	\$ 1.973	\$ 2.115	€ 404	€ 1.862
4	4	2	-	1	-	-	-	-	-
-6	-17	13	-2	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-11.414	-4.563	-14.415	9.501	-18.099	3.105	-4.202	2.483	-3.794	473
-45.874	-26.651	-41.738	-41.227	-13.755	-16.541	-6.019	-7.913	992	-2.404
-39.040	-9.098	-49.454	-26.267	-27.188	-8.459	-8.248	-3.315	-2.398	-69
3.084	4.099	1.557	1.925	239	515	23	41	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
321	342	290	298	118	151	49	55	8	33
187	301	107	130	3	1	4	6	-	-
12	8	12	6	4	4	1	1	-	1
35	41	23	27	23	27	23	27	12	24
30	45	27	45	13	20	5	8	2	4
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	6	8	2	2	1	2	14	28
4	3	3	3	1	2	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
122	113	77	86	60	46	21	22	2	15
3.796	4.953	2.102	2.528	463	768	128	163	38	106
-	-1	-	-2	-	-	-	-	-11	-
3.796	4.952	2.102	2.526	463	768	128	163	27	106
-42.836	-14.050	-51.556	-28.793	-27.651	-9.227	-8.376	-3.478	-2.425	-175
-6.139	-8.841	-3.697	-3.167	-	-	-	-	-1	-223
-48.975	-22.891	-55.253	-31.960	-27.651	-9.227	-8.376	-3.478	-2.426	-398
-449	-577	-4	13	-34	-41	-3	-7	-	-
\$ -49.424	\$ -23.468	\$ -55.257	\$ -31.947	\$ -27.685	\$ -9.268	\$ -8.379	\$ -3.485	€ -2.426	€ -398

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi- Asset Credit Fund [^]		Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 119.538	\$ 268.078	\$ –	\$ –	\$ 17.639	\$ 39.782	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	193	19	–	–	1	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	366	-398	–	–	14	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-808.592	445.215	–	–	-67.965	21.382	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	213.028	-1.088.186	–	–	-7.496	-75.250	–	–
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-475.467	-375.272	–	–	-57.807	-14.086	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	30.787	68.651	–	–	310	289	–	–
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	1.815	3.462	–	–	205	496	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	2.121	4.466	–	–	–	–	–	–
Anwaltsgebühren	90	91	–	–	14	10	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	35	41	–	–	24	26	–	–
Druckgebühren	213	557	–	–	38	74	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	112	178	–	–	4	8	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	23	38	–	–	2	5	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	536	1.126	–	–	92	125	–	–
Gesamtaufwendungen	35.732	78.610	–	–	689	1.033	–	–
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	-1	-1	–	–
Nettoaufwendungen insgesamt	35.732	78.610	–	–	688	1.032	–	–
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-511.199	-453.882	–	–	-58.495	-15.118	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-18.470	-42.036	–	–	-309	-37	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	-529.669	-495.918	–	–	-58.804	-15.155	–	–
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	-5.966	-7.309	–	–	-110	-277	–	–
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -535.635	\$ -503.227	\$ –	\$ –	\$ -58.914	\$ -15.432	\$ –	\$ –

	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 245	\$ 30	\$ 8.345	\$ 6.749	\$ 25.709	\$ 21.764	\$ 794	\$ 657
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	1	–	2	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	-39	-30	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	447	58	-33.243	-9.380	-104.216	-24.577	-2.007	262
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-1.476	-213	-8.855	-18.546	-9.919	-38.509	40	-940
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-784	-125	-33.791	-21.207	-88.424	-41.322	-1.173	-21
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	28	4	1.242	2.051	2.452	2.725	47	56
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	19	5	143	171	427	433	13	13
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	177	274	8	8	–	1
Anwaltsgebühren	5	–	4	4	15	11	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	16	18	35	34	23	27	23	27
Druckgebühren	1	–	1	21	41	63	2	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	3	–	25	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	1	3	5	4	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	22	6	20	58	112	122	13	11
Gesamtaufwendungen	91	33	1.626	2.616	3.108	3.393	98	109
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-50	-27	–	–	–	–	-36	-34
Nettoaufwendungen insgesamt	41	6	1.626	2.616	3.108	3.393	62	75
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-825	-131	-35.417	-23.823	-91.532	-44.715	-1.235	-96
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-1.003	-1.004	-877	-780	-6	-6
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	-825	-131	-36.420	-24.827	-92.409	-45.495	-1.241	-102
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	372	-294	-520	-1.043	-2	1
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -825	\$ -131	\$ -36.048	\$ -25.121	\$ -92.929	\$ -46.538	\$ -1.243	\$ -101

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 37.779	\$ 44.016	\$ 32.881	\$ 22.930	£ 1.738	£ 1.757	\$ 5.142	\$ 5.649	\$ 629	\$ 600
1	-	-	-	2	-	1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-25.905	-20.031	-47.722	-20.177	-6.233	233	-41.235	208	-3.160	-524
-63.132	-20.131	-96.912	-31.759	-6.171	-4.951	-4.223	-17.331	-792	-1.412
-51.257	3.854	-111.753	-29.006	-10.664	-2.961	-40.315	-11.474	-3.323	-1.335
1.351	4.001	97	7	-	-	61	65	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
475	681	780	610	46	50	95	116	19	19
28	50	-	-	-	-	1	1	-	-
35	16	29	14	2	1	4	3	1	-
35	53	23	27	15	15	23	27	23	42
57	104	61	89	4	6	10	17	1	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2	-	1	-	-	2	1	-	-	-
6	6	8	5	1	-	1	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
130	179	144	156	15	15	33	35	32	22
2.119	5.090	1.143	908	83	89	229	265	76	85
-	-	-	-	-	-	-	-	-76	-85
2.119	5.090	1.143	908	83	89	229	265	-	-
-53.376	-1.236	-112.896	-29.914	-10.747	-3.050	-40.544	-11.739	-3.323	-1.335
-945	-2.540	-	-	-757	-	-2.031	-	-686	-614
-54.321	-3.776	-112.896	-29.914	-11.504	-3.050	-42.575	-11.739	-4.009	-1.949
-	-	-	-	1	-3	-53	-25	-2	-5
\$ -54.321	\$ -3.776	\$ -112.896	\$ -29.914	£ -11.503	£ -3.053	\$ -42.628	\$ -11.764	\$ -4.011	\$ -1.954
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 8.940	\$ 8.885	\$ -	\$ -	\$ 55.299	\$ 37.405	\$ 2.445	\$ 2.123	\$ 613	\$ 579
-	-	-	-	9	-	1	-	-	-
-	-	-	-	18	216	-	-	-	-
-	-	1.930	33	-	-	-	-	-	-
-30.719	-12.083	-	1.878	-176.578	-49.978	-1.815	1.644	-1.880	-431
-13.662	-8.859	-	-1.972	-69.518	-69.045	-433	-2.028	128	-1.126
-35.441	-12.057	1.930	-61	-190.770	-81.402	198	1.739	-1.139	-978
1.293	1.870	-	-	9.957	9.953	592	575	34	44
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
162	190	-	-	917	725	52	37	11	12
8	12	-	-	1.089	1.084	18	20	-	-
6	4	-	-	43	10	1	1	-	-
22	17	-	-	49	27	23	27	34	28
15	27	-	-	80	87	4	5	2	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
3	2	-	-	14	1	1	-	-	-
1	3	-	-	13	4	-	-	-	-
-	-	1.930	33	-	-	-	-	-	-
26	62	-	-	312	196	26	18	30	13
1.536	2.187	1.930	33	12.474	12.087	717	683	111	98
-	-	-	-	-	-	-33	-11	-65	-37
1.536	2.187	1.930	33	12.474	12.087	684	672	46	61
-36.977	-14.244	-	-94	-203.244	-93.489	-486	1067	-1.185	-1.039
-121	-98	-	-	-24.709	-17.678	-	-	-588	-653
-37.098	-14.342	-	-94	-227.953	-111.167	-486	1.067	-1.773	-1.692
-162	-232	-	94	-847	-471	17	-28	-2	-
\$ -37.260	\$ -14.574	\$ -	\$ -	\$ -228.800	\$ -111.638	\$ -469	\$ 1.039	\$ -1.775	\$ -1.692

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	\$ 4.421	\$ 13.030	\$ 226	\$ –	\$ 52	\$ 39
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-19.601	-17.320	-254	–	79	253
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-1.726	-20.177	-139	–	-213	-90
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	–	–	-16.906	-24.467	-167	–	-82	202
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	3	39	17	–	12	10
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	59	148	6	–	7	7
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	2	–	–	1	–
Anwaltsgebühren	–	–	2	6	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	23	27	16	–	34	27
Druckgebühren	–	–	8	27	–	–	–	–
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	1	–	–	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	1	2	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	38	57	15	–	20	9
Gesamtaufwendungen	–	–	134	309	54	–	74	53
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-24	-20	-32	–	-58	-40
Nettoaufwendungen insgesamt	–	–	110	289	22	–	16	13
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	–	–	-17.016	-24.756	-189	–	-98	189
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	-2	–	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	–	–	-17.016	-24.756	-191	–	-98	189
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	–	–	-186	-315	-9	–	-14	-11
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ -17.202	\$ -25.071	\$ -200	\$ –	\$ -112	\$ 178

	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
	2023	2022	2023	2022	2023	2022	2023	2022
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 4.300	\$ 5.224	\$ 1.556	\$ 1.764	\$ 19.216	\$ 14.546	\$ 181	\$ 135
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-12	-1	–	–	-2	31	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	38.275	51.437	-49	1.547	-40.931	45.824	-164	1119
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-119.909	-133.605	-4.889	3.473	-118.836	12.537	-1.038	-1.289
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-77.346	-76.945	-3.382	6.784	-140.553	72.938	-1.021	-35
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	3.723	6.381	464	491	8.276	6.820	89	92
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	280	435	37	34	1.111	791	15	14
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	502	837	76	78	1.780	944	2	3
Anwaltsgebühren	9	11	1	1	43	16	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	35	41	23	27	30	26	11	13
Druckgebühren	–	45	3	4	81	103	1	1
Dividendenaufwand	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	2	–	–	10	13	–	–
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	3	4	–	–	13	5	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	58	103	35	18	250	181	19	14
Gesamtaufwendungen	4.610	7.859	639	653	11.594	8.899	137	137
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-40	-20	-89	-97	-26	-22
Nettoaufwendungen insgesamt	4.610	7.859	599	633	11.505	8.802	111	115
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-81.956	-84.804	-3.981	6.151	-152.058	64.136	-1.132	-150
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	-70	-226	-254	-86	-57	–	–
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	-81.956	-84.874	-4.207	5.897	-152.144	64.079	-1.132	-150
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	-851	-1.006	-370	-400	-5.143	-4.049	-30	-24
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -82.807	\$ -85.880	\$ -4.577	\$ 5.497	\$ -157.287	\$ 60.030	\$ -1.162	\$ -174

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 18.832	\$ 13.308	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 3.244	\$ 2.887	\$ 10.386	\$ 11.465
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-37	-16	-	-	-	-	-1	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27.825	57.129	-	-	-	-	10.875	32.551	119.361	207.591
-53.148	16.803	-	-	-	-	-27.103	-9.208	-379.934	-56.563
-6.528	87.224	-	-	-	-	-12.985	26.230	-250.187	162.493
7.465	6.023	-	-	-	-	2.177	2.550	10.827	16.022
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
655	462	-	-	-	-	146	143	998	1.229
689	640	-	-	-	-	359	414	1.464	2.089
23	10	-	-	-	-	5	3	42	26
17	15	-	-	-	-	23	27	35	42
46	64	-	-	-	-	13	19	100	172
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	1	-	-	-	-	-	-	1	1
6	3	-	-	-	-	1	1	10	11
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
169	113	-	-	-	-	104	42	315	332
9.070	7.331	-	-	-	-	2.828	3.199	13.792	19.924
-	-	-	-	-	-	-15	-	-	-
9.070	7.331	-	-	-	-	2.813	3.199	13.792	19.924
-15.598	79.893	-	-	-	-	-15.798	23.031	-263.979	142.569
-136	-148	-	-	-	-	-6	-16	-	-
-15.734	79.745	-	-	-	-	-15.804	23.015	-263.979	142.569
-5.023	-3.486	-	-	-	-	-921	-814	-2.801	-3.192
\$ -20.757	\$ 76.259	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -16.725	\$ 22.201	\$ -266.780	\$ 139.377
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
€ 24.238	€ 16.832	\$ 73	\$ 97	\$ 16.804	\$ 3.805	\$ 9.694	\$ 11.052	\$ 1.009	\$ 932
15	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-147	-339	-	-	-18	-5	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
97.667	57.894	-446	-91	-20.310	4.597	-26.757	324.314	3014	19.637
-99.004	76.407	12	-25	-33.358	1.715	-23.159	-253.086	-2.696	-19.173
22.769	150.794	-361	-19	-36.882	10.112	-40.222	82.280	1.327	1396
10.180	6.668	19	31	4.260	1.206	7.773	12.523	1.052	1.337
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
739	422	3	5	255	55	538	717	64	68
1.277	773	3	4	885	283	1.310	2.173	174	233
25	6	-	-	7	1	20	20	3	1
24	24	10	5	16	18	35	41	23	27
45	52	-	-	11	3	56	118	6	9
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
164	122	-	-	1	-	-	-	-	-
7	3	-	-	2	-	5	6	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
140	108	30	6	79	29	178	212	43	27
12.601	8.178	65	51	5.516	1.595	9.915	15.810	1.365	1.703
-	-	-40	-16	-	-8	-	-	-11	-
12.601	8.178	25	35	5.516	1.587	9.915	15.810	1.354	1.703
10.168	142.616	-386	-54	-42.398	8525	-50.137	66.470	-27	-307
-6.157	-3.289	-16	-10	-14.505	-3.291	-	-	-	-53
4.011	139.327	-402	-64	-56.903	5.234	-50.137	66.470	-27	-360
-4.301	-2.933	-	-9	-2.061	-590	-1.694	-2.924	-238	-225
€ -290	€ 136.394	\$ -402	\$ -73	\$ -58.964	\$ 4.644	\$ -51.831	\$ 63.546	\$ -265	\$ -585

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund ^Δ		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund ^Δ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^{Δ,α}		Legg Mason Japan Equity Fund ^Δ		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^Δ	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ 23	\$ 95	\$ 553	¥ -	¥ -	\$ 347	\$ 1.246
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-1	-305
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	2.559	1.626	430	-	-	-1.890	9.987
-	-	-	-2.683	-1.497	734	-	-	717	-20.160
-	-	-	-101	224	1.717	-	-	-827	-9.232
-	-	-	4	24	158	-	-	96	577
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	1	2	14	-	-	17	47
-	-	-	-	2	14	-	-	8	147
-	-	-	-	-	-	-	-	1	1
-	-	-	14	13	19	-	-	11	13
-	-	-	-	-	1	-	-	4	6
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	6	19	12	-	-	21	18
-	-	-	25	60	218	-	-	158	809
-	-	-	-23	-33	-14	-	-	-43	-119
-	-	-	2	27	204	-	-	115	690
-	-	-	-103	197	1.513	-	-	-942	-9.922
-	-	-	-1	-12	-81	-	-	-12	-
-	-	-	-104	185	1.432	-	-	-954	-9.922
-	-	-	53	-19	-96	-	-	-26	-66
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -51	\$ 166	\$ 1.336	¥ -	¥ -	\$ -980	\$ -9.988
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund ^Δ		FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund ^Δ		FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund ^Δ		Franklin Responsible Income 2028 Fund ^{Δ,π}	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ 1.449	\$ 1.071	\$ 1.445	\$ 1.564	\$ 749	\$ 590	€ 3.040	€ 1.585	€ 122	€ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-28.509	9.870	372	871	-2.480	2.438	-22.697	-462	-16	-
-7.103	-31.002	-3.071	86	-6.311	-11.888	-7.891	-20.881	-738	-
-34.163	-20.061	-1.254	2.521	-8.042	-8.860	-27.548	-19.758	-632	-
994	1.199	237	248	368	391	857	966	7	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
109	107	24	22	34	36	178	151	3	-
110	133	72	76	18	29	15	15	-	-
4	1	1	-	1	1	7	3	-	-
17	26	17	20	11	11	24	12	16	-
9	13	2	3	4	4	15	16	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	-	-	-	-	-	7	23	-	-
1	1	-	-	-	-	2	1	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
40	25	34	13	46	18	43	26	6	-
1.285	1.505	387	382	482	490	1.148	1.213	32	-
-	-	-40	-25	-41	-11	-11	-3	-20	-
1.285	1.505	347	357	441	479	1.137	1.210	12	-
-35.448	-21.566	-1.601	2.164	-8.483	-9.339	-28.685	-20.968	-644	-
-	-	-452	-497	-	-	-	-	-	-
-35.448	-21.566	-2.053	1.667	-8.483	-9.339	-28.685	-20.968	-644	-
-113	-106	-114	-105	-80	-76	-266	-150	-	-
\$ -35.561	\$ -21.672	\$ -2.167	\$ 1.562	\$ -8.563	\$ -9.415	€ -28.951	€ -21.118	€ -644	€ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

Franklin Templeton Global Funds Plc		
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
ANLAGEERTRÄGE:		
Bruttodividendenertrag und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 587.213	\$ 703.005
Zinsen (Erläuterung 2)	245	25
Ausgleich (Erläuterung 2)	129	-935
Sonstige Erträge	1.930	40
Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):		
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-1.491.020	1.182.053
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-1.248.346	-2.121.229
Gesamterträge/(-verluste) aus Anlagen	-2.149.849	-237.041
AUFWENDUNGEN:		
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	129.714	185.330
Erfolgsprämien (Erläuterung 4)	-	4
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	13.176	15.040
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	13.404	16.748
Anwaltsgebühren	541	354
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	1.266	1.418
Druckgebühren	1.234	2.154
Dividendenaufwand	-	103
Zinsaufwendungen	410	527
Vergütung und Spesen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	143	140
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.930	40
Sonstige Aufwendungen	4.664	4.522
Gesamtaufwendungen	166.482	226.380
Verzicht auf Spesen/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-1.695	-5.749
Nettoaufwendungen insgesamt	164.787	220.631
Nettogewinn/(-verlust) vor Finanzierungskosten	-2.314.636	-457.672
FINANZIERUNGSKOSTEN:		
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-112.586	-104.949
Gewinn/(Verlust) für das Geschäftsjahr	-2.427.222	-562.621
Quellensteuern auf Dividenden und andere Steuern	-33.107	-32.275
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -2.460.329	\$ -594.896

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

Gewinne und Verluste haben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäftsbetrieb ergeben, außer beim 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 Global Inflation Management Fund[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] und Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], 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, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum durchschnittlichen USD/EUR-Wechselkurs von 0,9590 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8551).

Die Pfund Sterling-Beträge für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden für die Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,8252 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7289).

Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

- α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.
 - β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.
 - γ Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 hat der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.
 - δ Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
 - ε Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.
 - λ Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.
 - μ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.
 - π Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.
 - τ Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
- [^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei
gelassen]

Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022						
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 3.020	\$ 15	\$ -28.336	\$ -12.092	\$ -193.460	\$ -70.200	€ -22.729	€ -4.863
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	1.682.979	1.451.140	38.164	60.505	631.688	808.697	8.626	44.520
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	9.839	75	941	1.215	943	1.763	4	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-1.781.547	-1.414.236	-111.756	-115.852	-778.561	-899.588	-2.820	-1.594
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-88.729	36.979	-72.651	-54.132	-145.930	-89.128	5.810	42.926
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-85.709	36.994	-100.987	-66.224	-339.390	-159.328	-16.919	38.063
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	919.324	882.330	232.906	299.130	1.488.090	1.647.418	149.386	111.323
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 833.615	\$ 919.324	\$ 131.919	\$ 232.906	\$ 1.148.700	\$ 1.488.090	€ 132.467	€ 149.386
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -10.381	\$ -6.922	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -3.361	\$ 2.416
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	7.829	43.436	-	-	-	-	6.133	11.051
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	235	582	-	-	-	-	45	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-22.230	-57.680	-	-	-	-	-62.342	-2.740
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-14.166	-13.662	-	-	-	-	-56.164	8.311
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-24.547	-20.584	-	-	-	-	-59.525	10.727
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	81.978	102.562	-	-	-	-	59.525	48.798
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 57.431	\$ 81.978	\$ -	\$ 59.525				
(in Tsd.)								
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -535.635	\$ -503.227	\$ -	\$ -	\$ -58.914	\$ -15.432	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	594.445	959.500	-	-	97.245	91.804	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	572	962	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-2.110.715	-2.919.481	-	-	-135.218	-786.331	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-1.515.698	-1.959.019	-	-	-37.973	-694.527	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-2.051.333	-2.462.246	-	-	-96.887	-709.959	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	4.183.834	6.646.080	-	-	371.899	1.081.858	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 2.132.501	\$ 4.183.834	\$ -	\$ -	\$ 275.012	\$ 371.899	\$ -	\$ -

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 ^Δ		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund ^Δ	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -2.933	\$ -575	\$ -42.348	\$ -18.397	\$ -27.899	\$ -3.237	\$ -4.856	\$ -5.334	\$ -2.114	\$ -4.484
5.974	61.237	116.601	157.618	80.773	180.706	9.398	29.799	1	6.972
336	549	524	1.017	2.460	2.300	790	961	319	1.525
-56.369	-34.652	-150.391	-493.200	-189.194	-139.796	-46.450	-7.077	-26.054	-16.398
-50.059	27.134	-33.266	-334.565	-105.961	43.210	-36.262	23.683	-25.734	-7.901
-52.992	26.559	-75.614	-352.962	-133.860	39.973	-41.118	18.349	-27.848	-12.385
52.992	26.433	302.969	655.931	259.100	219.127	41.118	22.769	27.848	40.233
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ 52.992	\$ 227.355	\$ 302.969	\$ 125.240	\$ 259.100	\$ -	\$ 41.118	\$ -	\$ 27.848
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund ^Δ		FTGF Western Asset Global Credit Fund ^Δ		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund ^Δ	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -49.424	\$ -23.468	\$ -55.257	\$ -31.947	\$ -27.685	\$ -9.268	\$ -8.379	\$ -3.485	€ -2.426	€ -398
59.409	52.803	309.635	169.168	20.632	42.911	669	3.979	4	14
101	221	18	4	-	-	-	-	-	77
-82.173	-146.671	-174.675	-211.675	-49.192	-116.987	-23.593	-5.866	-35.026	-16.590
-22.663	-93.647	134.978	-42.503	-28.560	-74.076	-22.924	-1.887	-35.022	-16.499
-72.087	-117.115	79.721	-74.450	-56.245	-83.344	-31.303	-5.372	-37.448	-16.897
509.794	626.909	444.249	518.699	202.948	286.292	77.353	82.725	37.448	54.345
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 437.707	\$ 509.794	\$ 523.970	\$ 444.249	\$ 146.703	\$ 202.948	\$ 46.050	\$ 77.353	€ -	€ 37.448
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^Δ		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund ^Δ		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund ^Δ		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund ^Δ		Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund ^Δ	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -54.321	\$ -3.776	\$ -112.896	\$ -29.914	£ -11.503	£ -3.053	\$ -42.628	\$ -11.764	\$ -4.011	\$ -1.954
10.281	245.803	87.515	358.299	69.541	1	134.961	4.849	330	1.116
-	-	-	-	396	-	-	-	655	606
-454.353	-289.248	-2.392	-4.521	-86.155	-	-172.727	-9.512	-491	-3
-444.072	-43.445	85.123	353.778	-16.218	1	-37.766	-4.663	494	1.719
-498.393	-47.221	-27.773	323.864	-27.721	-3.052	-80.394	-16.427	-3.517	-235
1.057.941	1.105.162	1147280	823.416	73.633	76.685	175.169	191.596	21.958	22.193
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 559.548	\$ 1.057.941	\$ 1.119.507	\$ 1.147.280	£ 45.912	£ 73.633	\$ 94.775	\$ 175.169	\$ 18.441	\$ 21.958

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -825	\$ -131	\$ -36.048	\$ -25.121	\$ -92.929	\$ -46.538	\$ -1.243	\$ -101
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	9.997	60.682	52.734	236.790	222.057	67	269
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	270	175	5	5	1	2
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-46	-	-78.530	-180.060	-357.313	-151.480	-21	-639
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-46	9.997	-17.578	-127.151	-120.518	70.582	47	-368
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-871	9.866	-53.626	-152.272	-213.447	24.044	-1.196	-469
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	9.866	-	215.635	367.907	752.718	728.674	11.590	12.059
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 8.995	\$ 9.866	\$ 162.009	\$ 215.635	\$ 539.271	\$ 752.718	\$ 10.394	\$ 11.590

(in Tsd.)	Legg Mason Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	\$ -17.202	\$ -25.071	\$ -200	\$ -	\$ -112	\$ 178
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	112	6.935	15.028	-	480	144
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	1	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-17.731	-268.929	-25	-	-11	-24
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-17.619	-261.994	15.004	-	469	120
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-34.821	-287.065	14.804	-	357	298
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	104.231	391.296	-	-	2.177	1.879
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ -	\$ 69.410	\$ 104.231	\$ 14.804	\$ -	\$ 2.534	\$ 2.177

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -82.807	\$ -85.880	\$ -4.577	\$ 5497	\$ -157.287	\$ 60.030	\$ -1.162	\$ -174
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKZAHLBAREN, GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	21.160	66.573	5.178	3.664	954.316	1.547.220	211	5.676
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	4	4	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-251.719	-233.232	-5.356	-4.575	-756.365	-653.159	-1.888	-573
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-230.559	-166.659	-174	-907	197.951	894.061	-1.677	5.103
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-313.366	-252.539	-4.751	4.590	40.664	954.091	-2.839	4.929
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	538.159	790.698	43.279	38.689	1.599.315	645.224	16.018	11.089
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 224.793	\$ 538.159	\$ 38.528	\$ 43.279	\$ 1.639.979	\$ 1.599.315	\$ 13.179	\$ 16.018

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -37.260	\$ -14.574	\$ -	\$ -	\$ -228.800	\$ -111.638	\$ -469	\$ 1.039	\$ -1.775	\$ -1.692
8.297	25.025	-	-	382.317	1.541.388	1.851	15.766	-	80
9	10	-	-	353	572	-	-	1	1
-10.296	-351.786	-	-	-551.638	-275.534	-7.012	-16.439	-	-
-1.990	-326.751	-	-	-168.968	1.266.426	-5.161	-673	1	81
-39.250	-341.325	-	-	-397.768	1.154.788	-5.630	366	-1.774	-1.611
244.396	585.721	-	-	1.608.073	453.285	52.386	52.020	10.163	11.774
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 205.146	\$ 244.396	\$ -	\$ -	\$ 1.210.305	\$ 1.608.073	\$ 46.756	\$ 52.386	\$ 8.389	\$ 10.163

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -20.757	\$ 76.259	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -16.725	\$ 22.201	\$ -266.780	\$ 139.377
283.185	538.051	-	-	-	-	27.366	68.093	375.752	690.529
4	8	-	-	-	-	-	2	-	-
-224.944	-231.165	-	-	-	-	-34.511	-82.824	-655.932	-868.263
58.245	306.894	-	-	-	-	-7.145	-14.729	-280.180	-177.734
37.488	383.153	-	-	-	-	-23.870	7.472	-546.960	-38.357
892.238	509.085	-	-	-	-	213.480	206.008	1.772.695	1.811.052
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 929.726	\$ 892.238	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 189.610	\$ 213.480	\$ 1225.735	\$ 1.772.695

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund ^{^e}		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
€ -290	€ 136.394	\$ -402	\$ -73	\$ -58.964	\$ 4.644	\$ -51.831	\$ 63.546	\$ -265	\$ -585
933.315	354.457	19	12	446.097	181.429	238.901	1.135.484	7.259	43.190
24	7	3	1	1.541	127	-	-	-	-
-541.640	-424.447	-2.285	-	-156.020	-12.806	-361.750	-1.571.691	-16.831	-45.766
391.699	-69.983	-2.263	13	291.618	168.750	-122.849	-436.207	-9.572	-2.576
391.409	66.411	-2.665	-60	232.654	173.394	-174.680	-372.661	-9.837	-3.161
671.424	605.013	2.665	2.725	173.394	-	916.209	1.288.870	87.935	91.096
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
€ 1.062.833	€ 671.424	\$ -	\$ 2.665	\$ 406.048	\$ 173.394	\$ 741.529	\$ 916.209	\$ 78.098	\$ 87.935

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]		Legg Mason US Equity Fund [^]		Franklin MV European Equity Growth and Income Fund ^{^y}		FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	
	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -294	\$ -466	\$ -	\$ -	€ -931	€ 3.996	\$ -3.091	\$ -14
TRANSAKTIONEN MIT Rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	14	5.000	-	-	305	6.191	2.902	3.002
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	88	62
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	-27.711	-15.218	-4.692	-8.204
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	14	5.000	-	-	-27.406	-9.027	-1.702	-5.140
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-280	4.534	-	-	-28.337	-5.031	-4.793	-5.154
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	4.534	-	-	-	28.337	33.368	25.883	31.037
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 4.254	\$ 4.534	\$ -	\$ -	€ -	€ 28.337	\$ 21.090	\$ 25.883

(in Tsd.)	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 [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum	Für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	€ -	€ 2.467	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT Rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	4.064	-	-	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-46.874	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-42.810	-	-	-	-
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-40.343	-	-	-	-
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	-	40.343	-	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ -	€ -	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -

(in Tsd.)	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum	für das Geschäftsjahr zum
	28. Februar 2023	28. Februar 2022
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -2.460.329	\$ -594.896
TRANSAKTIONEN MIT Rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen		
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	8.183.142	12.009.674
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	20.855	13.159
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-10.861.926	-13.536.166
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	-2.657.929	-1.513.333
Zunahme/(Abnahme) des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-5.118.258	-2.108.229
AUF DIE INHABER RÜCKKAUFBARER GEWINNBERECHTIGTER ANTEILE ENTFALLENDEN NETTOVERMÖGEN		
Zu Jahresbeginn	22.628.678	24.833.772
Währungsumrechnung	-82.390	-96.865
Zum Jahresende	\$ 17.428.030	\$ 22.628.678

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund [^]		Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^{^α}		Legg Mason Japan Equity Fund [^]		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -51	\$ 166	\$ 1.336	¥ -	¥ -	\$ -980	\$ -9.988
-	-	-	-	-	2.084	-	-	2.028	7.493
-	-	-	1	-	-	-	-	2	3
-	-	-	-14.689	-12.709	-3.562	-	-	-13.630	-61.470
-	-	-	-14.688	-12.709	-1.478	-	-	-11.600	-53.974
-	-	-	-14.739	-12.543	-142	-	-	-12.580	-63.962
-	-	-	14.739	12.543	12.685	-	-	16.118	80.080
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 12.543	¥ -	¥ -	\$ 3.538	\$ 16.118

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 ^{^π}	
Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
\$ -35.561	\$ -21.672	\$ -2.167	\$ 1.562	\$ -8.563	\$ -9.415	€ -28.951	€ -21.118	€ -644	€ -
65.616	179.010	853	1.646	14.408	26.119	29.019	355.457	37.528	-
-	-	285	308	-	-	-	-	-	-
-58.387	-92.306	-1.784	-2.158	-18.981	-10.667	-114.561	-142.120	-61	-
7.229	86.704	-646	-204	-4.573	15.452	-85.542	213.337	37.467	-
-28.332	65.032	-2.813	1.358	-13.136	6.037	-114.493	192.219	36.823	-
169.381	104.349	27.934	26.576	47.838	41.801	303.590	111.371	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
\$ 141.049	\$ 169.381	\$ 25.121	\$ 27.934	\$ 34.702	\$ 47.838	€ 189.097	€ 303.590	€ 36.823	€ -

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

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

Alle Euro-Beträge, außer dem zu Anfang des Jahres den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum durchschnittlichen USD/EUR-Wechselkurs von 0,9590 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,8551).

Das Anfang des Jahres den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Vermögen 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[^] und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,8919 am 28. Februar 2022 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 0,8288).

Alle Pfund Sterling-Beträge, außer dem zu Anfang des Jahres den Inhabern rückkaufbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für die Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 zum durchschnittlichen USD/GBP-Wechselkurs von 0,8252 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2022: 0,7289).

Das Anfang des Jahres den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Vermögen für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurde zur Berechnung des Gesamtbetrags zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7454 am 28. Februar 2022 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2021: 0,7178).

Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

- α Mit Wirkung vom 27. April 2022 stellte der Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.
- β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.
- γ Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 hat der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel eingestellt.
- δ Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
- ε Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.
- λ Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.
- μ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.
- π Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.
- τ Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.
- ^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	2.520	1.239			
Eingelöst	-2.240	-1.446			
Nettozunahme/(-abnahme)	280	-207			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	888.333	727.110			
Eingelöst	-1.002.262	-711.328			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-113.929	15.782			
Klasse B USD, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	218	-			
Eingelöst	-	-300			
Nettozunahme/(-abnahme)	218	-300			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	-	5			
Eingelöst	-50	-3			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-50	2			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	104			
Eingelöst	-7	-199			
Nettoabnahme	-6	-95			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	541.654	620.936			
Eingelöst	-542.008	-576.820			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-354	44.116			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	-	2			
Eingelöst	-	-2			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	73	83			
Eingelöst	-107	-104			
Nettoabnahme	-34	-21			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Eingelöst	-	-35			
Nettoabnahme	-	-35			
FTGF Western Asset US Core Bond Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	63	102			
Eingelöst	-78	-173			
Nettoabnahme	-15	-71			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	172	178			
Eingelöst	-556	-192			
Nettoabnahme	-384	-14			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	18	42			
Eingelöst	-35	-82			
Nettoabnahme	-17	-40			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	3	18			
Eingelöst	-9	-60			
Nettoabnahme	-6	-42			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	5	1			
Eingelöst	-18	-33			
Nettoabnahme	-13	-32			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	156	203			
Eingelöst	-329	-377			
Nettoabnahme	-173	-174			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	40	104			
Eingelöst	-48	-146			
Nettoabnahme	-8	-42			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	2	21			
Eingelöst	-2	-35			
Nettoabnahme	-	-14			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	2			
Eingelöst	-1	-2			
Nettozunahme	-	-			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	16	4			
Eingelöst	-104	-9			
Nettoabnahme	-88	-5			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	24			
Eingelöst	-23	-34			
Nettoabnahme	-22	-10			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	5	39			
Eingelöst	-	-2			
Nettozunahme	5	37			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Verkauft	-	3			
Eingelöst	-1	-4			
Nettoabnahme	-1	-1			
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	276	488			
Eingelöst	-294	-905			
Nettoabnahme	-18	-417			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	138	151			
Eingelöst	-255	-200			
Nettoabnahme	-117	-49			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	10	17			
Eingelöst	-37	-220			
Nettoabnahme	-27	-203			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	59	89			
Eingelöst	-37	-22			
Nettozunahme	22	67			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	9	8			
Eingelöst	-13	-66			
Nettoabnahme	-4	-58			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Eingelöst	-1	-1			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	24	28			
Eingelöst	-54	-107			
Nettoabnahme	-30	-79			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	6	7			
Eingelöst	-19	-31			
Nettoabnahme	-13	-24			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	39	78			
Eingelöst	-89	-212			
Nettoabnahme	-50	-134			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	2.966	3.782			
Eingelöst	-3.556	-1.893			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-590	1.889			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	28	85			
Eingelöst	-45	-107			
Nettoabnahme	-17	-22			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	11	85			
Eingelöst	-54	-251			
Nettoabnahme	-43	-166			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	8	57			
Eingelöst	-24	-42			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-16	15			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund – (Fortsetzung)				
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	13		
Eingelöst	-27	-125		
Nettoabnahme	-23	-112		
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Eingelöst	-	-4		
Nettoabnahme	-	-4		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	1.800	1.083		
Eingelöst	-2.219	-2.015		
Nettoabnahme	-419	-932		
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	5	13		
Eingelöst	-1	-		
Nettozunahme	4	13		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	277	186		
Eingelöst	-146	-571		
Nettozunahme/(-abnahme)	131	-385		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	42	263		
Eingelöst	-78	-21		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-36	242		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Eingelöst	-1	-2		
Nettoabnahme	-1	-2		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Verkauft	-	1		
Eingelöst	-	-1		
Nettozunahme	-	-		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	-	2		
Eingelöst	-1	-2		
Nettoabnahme	-1	-		
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund				
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Zurückgenommen	-	-2		
Nettoabnahme	-	-2		
Klasse A EUR, ausschüttend (D)				
Verkauft	-	3		
Eingelöst	-2	-3		
Nettoabnahme	-2	-		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	-	1		
Eingelöst	-	-1		
Nettozunahme	-	-		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	88	31		
Eingelöst	-24	-25		
Nettozunahme	64	6		
Klasse LM EUR, thesaurierend				
Verkauft	-	381		
Eingelöst	-3	-3		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	378		
Klasse GA EUR, thesaurierend				
Eingelöst	-	-1		
Nettoabnahme	-	-1		
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^{At}				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	9	254		
Eingelöst	-153	-156		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-144	98		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	9	84		
Eingelöst	-99	-28		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-90	56		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	-	1		
Eingelöst	-2	-2		
Nettoabnahme	-2	-1		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	-	1		
Eingelöst	-3	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	1		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	5		
Eingelöst	-10	-1		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	4		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	7	1		
Eingelöst	-45	-1		
Nettoabnahme	-38	-		
Klasse B USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	-1	-		
Nettoabnahme	-1	-		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	10	46		
Eingelöst	-57	-21		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-47	25		
Klasse C USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	2	38		
Eingelöst	-48	-13		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-46	25		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	-	33		
Eingelöst	-29	-25		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-29	8		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	23	14		
Eingelöst	-23	-16		
Nettoabnahme	-	-2		
Klasse A (G) USD, thesaurierend				
Verkauft	-	2		
Eingelöst	-5	-2		
Nettoabnahme	-5	-		
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	-38	-15		
Nettoabnahme	-37	-13		
Klasse L (G) USD, thesaurierend				
Eingelöst	-6	-		
Nettoabnahme	-6	-		
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)				
Eingelöst	-2	-		
Nettoabnahme	-2	-		
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	25	79		
Eingelöst	-38	-108		
Nettoabnahme	-13	-29		
Klasse A USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	12	27		
Eingelöst	-17	-148		
Nettoabnahme	-5	-121		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	1	7		
Eingelöst	-2	-10		
Nettoabnahme	-1	-3		
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	16	8		
Eingelöst	-22	-11		
Nettoabnahme	-6	-3		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	3	-		
Eingelöst	-1	-		
Nettozunahme	2	-		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	8	7		
Eingelöst	-12	-24		
Nettoabnahme	-4	-17		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Zurückgenommen	-	-1		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Nettoabnahme	-	(1)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	8	3
Eingelöst	-10	-13
Nettoabnahme	-2	-10
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-1	-1
Nettozunahme	-	-
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	-5	-
Nettoabnahme	-5	-
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	116	823
Eingelöst	-53	-613
Nettozunahme	63	210
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-2	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	11	16
Eingelöst	-11	-26
Nettoabnahme	-	-10
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	14	21
Eingelöst	-27	-29
Nettoabnahme	-13	-8
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	7	732
Eingelöst	-7	-744
Nettoabnahme	-	-12
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	3	1
Eingelöst	-4	-4
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-	-2
Nettoabnahme	-	-1
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	31	47
Eingelöst	-45	-42
Netto-(Abgang)/-Zugang	-14	5
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	-	3
Eingelöst	-	-15
Nettoabnahme	-	-12
Klasse X USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-7	-15
Nettoabnahme	-7	-13
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	256	87
Eingelöst	-298	-124
Nettoabnahme	-42	-37
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	27	342
Eingelöst	-129	-308
Netto-(Abgang)/-Zugang	-102	34
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	522	13
Eingelöst	-28	-
Nettozunahme	494	13
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	30
Eingelöst	-21	-32
Nettoabnahme	-20	-2
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	-266	-70
Nettoabnahme	-266	-70

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-	-1
Nettozunahme	-	-
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-15	-168
Nettoabnahme	-15	-167
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-27	-83
Nettoabnahme	-26	-82
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	72	387
Eingelöst	-350	-83
Netto-(Abgang)/-Zugang	-278	304
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	-
Eingelöst	-1	-1.360
Nettoabnahme	-	-1.360
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	32	235
Eingelöst	-56	-219
Netto-(Abgang)/-Zugang	-24	16
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	108	280
Eingelöst	-143	-262
Netto-(Abgang)/-Zugang	-35	18
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	69
Eingelöst	-14	-130
Nettoabnahme	-12	-61
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	5	15
Eingelöst	-12	-7
Netto-(Abgang)/-Zugang	-7	8
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Nettozunahme	4	1
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	1
Eingelöst	-2	-1
Nettozunahme	-	-
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	22	629
Eingelöst	-153	-613
Netto-(Abgang)/-Zugang	-131	16
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-2	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	2
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-	-12
Nettoabnahme	-	-10
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	9	4
Eingelöst	-2	-7
Nettozunahme/(-abnahme)	7	-3
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	3	8
Eingelöst	-7	-9
Nettoabnahme	-4	-1
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	7	4
Eingelöst	-8	-3
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-5	-2
Nettoabnahme	-4	-
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	-	1
Nettozunahme	-	1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund – (Fortsetzung)					
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	18	47			
Eingelöst	-34	-41			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-16	6			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	2	2			
Eingelöst	-1	-			
Nettozunahme	1	2			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	-	9			
Eingelöst	-	-9			
Nettozunahme	-	-			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	405	469			
Eingelöst	-749	-289			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-344	180			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-6			
Nettoabnahme	-	-6			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Eingelöst	-232	-			
Nettoabnahme	-232	-			
Klasse LM USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	18	255			
Eingelöst	-	-158			
Nettozunahme	18	97			
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-2			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-1			
Nettozunahme	-	-			
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]δ					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	-	10			
Eingelöst	-32	-22			
Nettoabnahme	-32	-12			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	2			
Eingelöst	-14	-7			
Nettoabnahme	-14	-5			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	19	-			
Eingelöst	-19	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	-	6			
Eingelöst	-10	-7			
Nettoabnahme	-10	-1			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-2	-1			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-4	-			
Nettoabnahme	-4	-			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	112	10			
Eingelöst	-129	-1			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-17	9			
Klasse C USD, thesaurierend					
Eingelöst	-2	-			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Eingelöst	-10	-4			
Nettoabnahme	-10	-4			
Klasse E USD, ausschüttend (D)					
Eingelöst	-5	-3			
Nettoabnahme	-5	-3			
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Zurückgenommen	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Eingelöst	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	5			
Eingelöst	-15	-11			
Nettoabnahme	-15	-6			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-1	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1			
LM KLASSE USD, ausschüttend (M) (abgesichert)					
Verkauft	105	288			
Eingelöst	-393	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-288	288			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-3	-2			
Nettoabnahme	-3	-1			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-9	-2			
Nettoabnahme	-9	-1			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	-7	-			
Nettoabnahme	-7	-			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Eingelöst	-10	-			
Nettoabnahme	-10	-			
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]β					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	38			
Eingelöst	-18	-24			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-18	14			
Klasse LM USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	4	57			
Eingelöst	-290	-155			
Nettoabnahme	-286	-98			
FTGF Western Asset Global High Yield Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	10	32			
Eingelöst	-25	-41			
Nettoabnahme	-15	-9			
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	17	24			
Eingelöst	-22	-47			
Nettoabnahme	-5	-23			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	11	116			
Eingelöst	-73	-68			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-62	48			
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft	58	32			
Eingelöst	-75	-48			
Nettoabnahme	-17	-16			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)					
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	55	29			
Eingelöst	-70	-34			
Nettoabnahme	-15	-5			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	5	17			
Eingelöst	-2	-16			
Nettozunahme	3	1			
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	–	-5			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-5			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	525	2.905			
Eingelöst	-855	-16.116			
Nettoabnahme	-330	-13.211			
Klasse B USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	-3	-4			
Nettoabnahme	-3	-1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	2			
Eingelöst	-4	-2			
Nettoabnahme	-3	–			
Klasse C USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	–	5			
Eingelöst	-3	-25			
Nettoabnahme	-3	-20			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	1	4			
Eingelöst	-1	-3			
Nettozunahme	–	1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	13	13			
Eingelöst	-7	-2			
Nettozunahme	6	11			
Klasse F USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	2	39			
Eingelöst	-6	-38			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	1			
Klasse X USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	5	32			
Eingelöst	-12	-8			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-7	24			
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)					
Verkauft	10	19			
Eingelöst	-7	-3			
Nettozunahme	3	16			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	–	56			
Eingelöst	-29	-91			
Nettoabnahme	-29	-35			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	8	3			
Eingelöst	-1	-2			
Nettozunahme	7	1			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	–	3			
Eingelöst	-1	-3			
Nettoabnahme	-1	–			
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	2			
Eingelöst	-2	-13			
Nettoabnahme	-1	-11			
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	–	-1			
Nettozunahme	1	–			
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^μ					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	18	14			
Eingelöst	-41	-4			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-23	10			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft			7	22	
Eingelöst			-43	-28	
Nettoabnahme			-36	-6	
Klasse B USD, thesaurierend					
Eingelöst			–	-1	
Nettoabnahme			–	-1	
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft			1	2	
Eingelöst			-2	-1	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-1	1	
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft			–	2	
Eingelöst			-6	–	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-6	2	
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft			11	–	
Eingelöst			-11	–	
Nettozunahme			–	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			12	72	
Eingelöst			-75	-9	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-63	63	
Klasse LM USD, thesaurierend					
Eingelöst			-369	–	
Nettoabnahme			-369	–	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft			57	117	
Eingelöst			-102	-145	
Nettoabnahme			-45	-28	
Klasse A USD, ausschüttend (D)					
Verkauft			6	12	
Eingelöst			-9	-18	
Nettoabnahme			-3	-6	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft			89	150	
Eingelöst			-241	-561	
Nettoabnahme			-152	-411	
Klasse A USD, ausschüttend (M)					
Verkauft			28	13	
Eingelöst			-50	-82	
Nettoabnahme			-22	-69	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			127	34	
Eingelöst			-200	-158	
Nettoabnahme			-73	-124	
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)					
Zurückgenommen			–	-5	
Nettoabnahme			–	-5	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			53	53	
Eingelöst			-117	-240	
Nettoabnahme			-64	-187	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			5	6	
Eingelöst			-10	-14	
Nettoabnahme			-5	-8	
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft			2	5	
Eingelöst			-5	-12	
Nettoabnahme			-3	-7	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen			–	-1	
Nettoabnahme			–	-1	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft			64	145	
Eingelöst			-358	-1.076	
Nettoabnahme			-294	-931	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			34	94	
Eingelöst			-540	-348	
Nettoabnahme			-506	-254	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	254	3.739
Eingelöst	-1.658	-5.937
Nettoabnahme	-1.404	-2.198
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	603	4.131
Eingelöst	-1.017	-4.100
Netto-(Abgang)/-Zugang	-414	31
Klasse B USD, ausschüttend (D)		
Eingelöst	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	-1	-3
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-9
Nettoabnahme	–	-8
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-1	-3
Nettoabnahme	–	-2
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	6	9
Eingelöst	-7	-67
Nettoabnahme	-1	-58
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	-2	-70
Nettoabnahme	-2	-68
Klasse X USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	3
Eingelöst	-26	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-25	3
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	156	73
Eingelöst	-56	-110
Nettozunahme/(-abnahme)	100	-37
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	39	40
Eingelöst	-26	-42
Nettozunahme/(-abnahme)	13	-2
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	51	52
Eingelöst	-44	-30
Nettozunahme	7	22
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	168
Eingelöst	–	-157
Nettozunahme	–	11
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	218
Eingelöst	–	-228
Nettoabnahme	–	-10
Klasse Premier EUR ausschüttend (M)		
Verkauft	–	102
Eingelöst	–	-102
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	-84	-12
Nettoabnahme	-84	-12

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	59	–
Eingelöst	-10	–
Nettozunahme	49	–
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	15	10
Eingelöst	-10	–
Nettozunahme	5	10
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	225	108
Eingelöst	-147	-179
Nettozunahme/(-abnahme)	78	-71
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	30	65
Eingelöst	-19	-97
Nettozunahme/(-abnahme)	11	-32
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	197	62
Eingelöst	-66	-72
Nettozunahme/(-abnahme)	131	-10
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	3	–
Nettozunahme	3	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1.454	2.641
Eingelöst	-2.223	-446
Netto-(Abgang)/-Zugang	-769	2.195
Klasse B USD, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	-3
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-3
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	12	42
Eingelöst	-49	-14
Netto-(Abgang)/-Zugang	-37	28
Klasse C USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	37	2
Eingelöst	-5	-1
Nettozunahme	32	1
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	19	16
Eingelöst	-17	-21
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-5
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	-3
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-3
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	12	47
Eingelöst	-44	-89
Nettoabnahme	-32	-42
Klasse F USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	1	16
Eingelöst	-3	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	15
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	48	88
Eingelöst	-46	-28
Nettozunahme	2	60
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	334	223
Eingelöst	-339	-189
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	34
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	666	170
Eingelöst	-287	-190
Nettozunahme/(-abnahme)	379	-20
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	2	–
Eingelöst	-4	-2
Nettoabnahme	-2	-2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-10	-9
Nettoabnahme	-9	-8
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	272	10
Eingelöst	-70	-121
Nettozunahme/(-abnahme)	202	-111
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	49	4
Eingelöst	-8	-10
Nettozunahme/(-abnahme)	41	-6
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1.035	337
Eingelöst	-454	-756
Nettozunahme/(-abnahme)	581	-419
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	155
Nettozunahme	–	155
Klasse S AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Eingelöst	–	-20
Nettoabnahme	–	-20
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^		
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	–	24
Eingelöst	-7	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-7	23
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	84	176
Eingelöst	-179	-644
Nettoabnahme	-95	-468
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	124	53
Eingelöst	-238	-62
Nettoabnahme	-114	-9
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)		
Eingelöst	–	-42
Nettoabnahme	–	-42
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	6	13
Eingelöst	-2	-10
Nettozunahme	4	3
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	25	24
Eingelöst	-27	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	23
FTGF Western Asset Global Credit Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	1	15
Eingelöst	-6	-5
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	10
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	1
Eingelöst	-2	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	2
Eingelöst	-152	-23
Nettoabnahme	-152	-21

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	6	9
Eingelöst	-2	-5
Nettozunahme	4	4
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^β		
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-205	-43
Nettoabnahme	-205	-43
Klasse LM EUR, ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-83
Nettoabnahme	–	-82
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	422	2.007
Eingelöst	-3.118	-3.791
Nettoabnahme	-2.696	-1.784
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	432	879
Eingelöst	-1.059	-1.679
Nettoabnahme	-627	-800
Klasse A USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	43	196
Eingelöst	-140	-398
Nettoabnahme	-97	-202
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-2	-25
Nettoabnahme	-1	-23
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	18	41
Eingelöst	-103	-267
Nettoabnahme	-85	-226
Klasse A CHF, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	19
Eingelöst	-96	-56
Nettoabnahme	-89	-37
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	7	22
Eingelöst	-7	-58
Nettoabnahme	–	-36
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	71
Eingelöst	-82	-78
Nettoabnahme	-82	-7
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	779	1.392
Eingelöst	-2.137	-2.029
Nettoabnahme	-1.358	-637
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	6	23
Eingelöst	-24	-45
Nettoabnahme	-18	-22
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	6	26
Eingelöst	-18	-68
Nettoabnahme	-12	-42
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	10	23
Eingelöst	-9	-61
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-38
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	42
Eingelöst	-98	-339
Nettoabnahme	-96	-297
Klasse A GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	5	25
Eingelöst	-15	-82
Nettoabnahme	-10	-57

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^A – (Fortsetzung)		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	39
Eingelöst	–	-97
Nettoabnahme	–	-58
Klasse A SEK, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	33	166
Eingelöst	-172	-4.643
Nettoabnahme	-139	-4.477
Klasse A SGD, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	–	27.402
Eingelöst	-12.989	-25.220
Netto--Abgang/-Zugang	-12.989	2182
Klasse A SGD, ausschüttend -M -abgesichert Plus -e		
Verkauft	2.598	13.149
Eingelöst	-18.843	-39.116
Nettoabnahme	-16.245	-25.967
Klasse A SGD, ausschüttend -M Plus -e		
Verkauft	–	50
Nettozunahme	–	50
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	36	164
Eingelöst	-127	-343
Nettoabnahme	-91	-179
Klasse C USD, ausschüttend -S		
Verkauft	1	6
Eingelöst	-13	-23
Nettoabnahme	-12	-17
Klasse A JPY, ausschüttend -M Plus -e		
Verkauft	2	–
Eingelöst	-2	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A NOK thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	379	594
Eingelöst	-326	-185
Nettozunahme	53	409
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	18	57
Eingelöst	-50	-158
Nettoabnahme	-32	-101
Klasse E USD, ausschüttend -S		
Verkauft	2	4
Eingelöst	-7	-9
Nettoabnahme	-5	-5
Klasse E EUR, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	1	3
Eingelöst	-10	-38
Nettoabnahme	-9	-35
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	157	476
Eingelöst	-711	-784
Nettoabnahme	-554	-308
Klasse F USD, ausschüttend -S		
Verkauft	5	78
Eingelöst	-43	-71
Netto--Abgang/-Zugang	-38	7
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	113	469
Eingelöst	-809	-892
Nettoabnahme	-696	-423
Klasse X USD, ausschüttend -M Plus -e		
Verkauft	24	163
Eingelöst	-223	-295
Nettoabnahme	-199	-132
Klasse X USD, ausschüttend -S		
Verkauft	9	67
Eingelöst	-83	-99
Nettoabnahme	-74	-32
Klasse X CHF, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	49	52
Eingelöst	-180	-107
Nettoabnahme	-131	-55

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse X EUR, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	1.583	374
Eingelöst	-2.307	-734
Nettoabnahme	-724	-360
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	9
Eingelöst	-18	-82
Nettoabnahme	-17	-73
Klasse X EUR, ausschüttend -A -abgesichert		
Verkauft	39	148
Eingelöst	-42	-165
Nettoabnahme	-3	-17
Klasse X Euro, ausschüttend -M -abgesichert		
Verkauft	–	8
Eingelöst	-38	-10
Nettoabnahme	-38	-2
Klasse X GBP thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	56	135
Eingelöst	-232	-319
Nettoabnahme	-176	-184
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Eingelöst	-3	-17
Nettoabnahme	-3	-14
Klasse X GBP, ausschüttend -M -abgesichert Plus -e		
Verkauft	3	27
Eingelöst	-40	-39
Nettoabnahme	-37	-12
Klasse X SGD, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	1.105	1.560
Eingelöst	-1.369	-1.457
Netto--Abgang/-Zugang	-264	103
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	984	745
Eingelöst	-1.350	-3.017
Nettoabnahme	-366	-2.272
Klasse Premier USD, ausschüttend -S		
Verkauft	10	333
Eingelöst	-304	-674
Nettoabnahme	-294	-341
Klasse Premier AUD, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	1	–
Eingelöst	-17	-27
Nettoabnahme	-16	-27
Klasse Premier AUD, ausschüttend -S -abgesichert		
Verkauft	13	111
Eingelöst	-574	-153
Nettoabnahme	-561	-42
Klasse Premier BRL, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	92	213
Eingelöst	-3.104	-1.727
Nettoabnahme	-3.012	-1.514
Klasse Premier CHF, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	8	49
Eingelöst	-112	-80
Nettoabnahme	-104	-31
Klasse Premier CHF, ausschüttend -S -abgesichert		
Verkauft	9	25
Eingelöst	-20	-20
Netto--Abgang/-Zugang	-11	5
Klasse Premier EUR, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	1.114	3.637
Eingelöst	-2.581	-4.003
Nettoabnahme	-1.467	-366
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	12	89
Eingelöst	-60	-114
Nettoabnahme	-48	-25
Klasse Premier EUR, ausschüttend -S -abgesichert		
Verkauft	318	124
Eingelöst	-98	-826
Nettozunahme/--abnahme	220	-702
Klasse Premier GBP, thesaurierend -abgesichert		
Verkauft	21	147
Eingelöst	-513	-1.148
Nettoabnahme	-492	-1.001

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – Fortsetzung					
Klasse Premier GBP, ausschüttend -M -abgesichert Plus -e					
Verkauft	71	556			
Eingelöst	-1.114	-2.011			
Nettoabnahme	-1.043	-1.455			
Klasse Premier JPY, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	101	38			
Eingelöst	-165	-92			
Nettoabnahme	-64	-54			
Klasse Premier JPY, ausschüttend -S -abgesichert					
Eingelöst	-100	–			
Nettoabnahme	-100	–			
Klasse Premier PLN, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	24	–			
Eingelöst	-35	-74			
Nettoabnahme	-11	-74			
Klasse Premier SEK, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	-1	-12			
Nettoabnahme	-1	-11			
Klasse S USD, thesaurierend					
Eingelöst	-83	-14			
Nettoabnahme	-83	-14			
Klasse S EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	–	1.215			
Eingelöst	-9	-1.404			
Nettoabnahme	-9	-189			
Klasse LM AUD, ausschüttend -S -abgesichert					
Verkauft	72	237			
Eingelöst	-738	-432			
Nettoabnahme	-666	-195			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-2	-2			
Nettoabnahme	-1	-1			
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	-1	–			
Netto-Abgang/-Zugang	-1	1			
Klasse A USD, ausschüttend -M Plus -e					
Verkauft	–	1			
Nettozunahme	–	1			
Klasse Premier EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	19	59			
Eingelöst	-50	-81			
Nettoabnahme	-31	-22			
Klasse Premier GBP, ausschüttend -M -abgesichert Plus -e					
Eingelöst	-3	–			
Nettoabnahme	-3	–			
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	1	7			
Eingelöst	-3	-7			
Nettoabnahme	-2	–			
Klasse S EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	40	99			
Eingelöst	-31	-87			
Nettozunahme	9	12			
Klasse S GBP, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	50	58			
Eingelöst	-29	-18			
Nettozunahme	21	40			
Klasse LM AUD, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	–	227			
Eingelöst	-1.230	-57			
Netto-Abgang/-Zugang	-1.230	170			
Klasse LM EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	25	340			
Eingelöst	-65	-269			
Netto-Abgang/-Zugang	-40	71			
Klasse LM GBP, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	418	99			
Eingelöst	-206	-4.253			
Nettozunahme/–abnahme	212	-4.154			
Klasse LM CAD, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	271	–			
Eingelöst	-9	–			
Nettozunahme	262	–			
Klasse S CHF, ausschüttend -A -abgesichert					
Verkauft	40	–			
Nettozunahme	40	–			
Klasse S CHF ausschüttend -A					
Verkauft	–	200			
Nettozunahme	–	200			
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]					
Klasse D EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	14	6			
Eingelöst	-10	-8			
Nettozunahme/–abnahme	4	-2			
Klasse D USD, thesaurierend					
Verkauft	3	–			
Eingelöst	-17	-91			
Nettoabnahme	-14	-91			
Klasse D USD, ausschüttend -M Plus					
Eingelöst	–	-107			
Nettoabnahme	–	-107			
Klasse D USD, ausschüttend -M					
Verkauft	2	3			
Eingelöst	-2	-256			
Nettoabnahme	–	-253			
Klasse M CHF, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	–	1			
Eingelöst	-10	-6			
Nettoabnahme	-10	-5			
Klasse M GBP, ausschüttend -M -abgesichert					
Zurückgenommen	-6	–			
Nettoabnahme	-6	–			
Klasse F USD, thesaurierend					
Eingelöst	-4	–			
Nettoabnahme	-4	–			
Klasse M USD, thesaurierend					
Eingelöst	-7	-8			
Nettoabnahme	-7	-8			
Klasse M USD, ausschüttend -M					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-10			
Nettoabnahme	–	-9			
Klasse M EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	–	8			
Eingelöst	-8	–			
Netto-Abgang/-Zugang	-8	8			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	82	299			
Eingelöst	-1.417	-456			
Nettoabnahme	-1.335	-157			
Klasse Premier USD, ausschüttend -Q					
Eingelöst	-7	-22			
Nettoabnahme	-7	-22			
Klasse Premier EUR, thesaurierend -abgesichert					
Verkauft	8	750			
Eingelöst	-1.094	-1.241			
Nettoabnahme	-1.086	-491			
Klasse Premier EUR ausschüttend -Q -abgesichert					
Verkauft	3	34			
Eingelöst	-175	-110			
Nettoabnahme	-172	-76			
Klasse Premier GBP, ausschüttend -M -abgesichert Plus -e					
Verkauft	–	17			
Eingelöst	-105	-5			
Netto-Abgang/-Zugang	-105	12			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	–	708			
Eingelöst	-705	-11			
Netto-Abgang/-Zugang	-705	697			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]				
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	585	–	35	32
Eingelöst	–	-18	-39	-45
Nettozunahme/(-abnahme)	585	-18	-4	-13
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	19	7	–	-3
Eingelöst	-25	-29	–	-3
Nettoabnahme	-6	-22	–	–
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	266	3.160	9	22
Nettozunahme	266	3.160	-54	-102
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]				
Klasse LM GBP, thesaurierend				
Eingelöst	-637	–	-45	-45
Nettoabnahme	-637	–	-4	-13
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)				
Verkauft	700	–	–	–
Eingelöst	-196	–	–	–
Nettozunahme	504	–	–	–
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	–	2	–	-1
Eingelöst	-4	-72	–	-1
Nettoabnahme	-4	-70	–	-1
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	7	197	1	2
Eingelöst	-14	-158	–	-3
Netto-(Abgang)/-Zugang	-7	39	1	-1
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	31	7	5	8
Eingelöst	-38	-10	-10	-18
Nettoabnahme	-7	-3	-5	-10
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	-951	–	–	-1
Nettoabnahme	-951	–	–	-1
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1.075	–	–	-1
Eingelöst	-371	–	–	-1
Nettozunahme	704	–	–	-1
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]				
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)				
Verkauft	12	18	–	-1
Eingelöst	-6	–	–	-1
Nettozunahme	6	18	–	-1
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]				
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	–	25	–	2
Nettozunahme	–	25	–	2
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	–	142	–	-8
Eingelöst	-2	–	–	-8
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	142	–	-6
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	–	48	–	2
Nettozunahme	–	48	–	2
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	8	38	3	2
Eingelöst	-16	-73	-1	-8
Nettoabnahme	-8	-35	–	-6
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Eingelöst	–	-3	–	-5
Nettoabnahme	–	-3	–	-5
Klasse A USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	12	3	–	-5
Eingelöst	-17	-7	–	-5
Nettoabnahme	-5	-4	–	-1
Klasse A USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	–	–	–	–
Eingelöst	–	–	–	–
Nettoabnahme	–	–	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Eingelöst	–	–	–	–
Nettoabnahme	–	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Verkauft	–	–	–	–
Eingelöst	–	–	–	–
Nettoabnahme	–	–	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	5	7	–	–
Eingelöst	-6	-2	–	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	5	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Eingelöst	-2	-2	–	–
Nettoabnahme	-2	-2	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Verkauft	2	2	–	–
Eingelöst	-5	-19	–	–
Nettoabnahme	-3	-17	–	–
Klasse A EUR, ausschüttend (S)				
Eingelöst	–	-1	–	-1
Nettoabnahme	–	-1	–	-1
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)				
Verkauft	1	2	–	–
Eingelöst	–	-3	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-1	–	–
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Verkauft	5	8	–	–
Eingelöst	-10	-18	–	–
Nettoabnahme	-5	-10	–	–
Klasse A SGD, thesaurierend				
Verkauft	5	3.290	–	–
Eingelöst	-1	-3.362	–	–
Nettozunahme/(-abnahme)	4	-72	–	–
Klasse B USD, ausschüttend (S)				
Zurückgenommen	–	-1	–	-1
Nettoabnahme	–	-1	–	-1
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	–	5	–	5
Eingelöst	-1	-9	–	-9
Nettoabnahme	-1	-4	–	-4
Klasse C USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	–	2	–	2
Eingelöst	-1	-9	–	-9
Nettoabnahme	-1	-7	–	-7
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	3	2	–	2
Eingelöst	-1	-8	–	-8
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-6	–	-6
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)				
Eingelöst	-1	-5	–	-5
Nettoabnahme	-1	-5	–	-5
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	2	2	–	2
Eingelöst	-10	-1	–	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	1	–	1
Klasse F USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	–	2	–	2
Eingelöst	-1	-2	–	-2
Nettoabnahme	-1	–	–	–
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)				
Zurückgenommen	–	-1	–	-1
Nettoabnahme	–	-1	–	-1
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	59	6	–	6
Eingelöst	-62	-5	–	-5
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	1	–	1
Klasse X USD, ausschüttend (S)				
Verkauft	–	3	–	3
Eingelöst	-2	-4	–	-4
Nettoabnahme	-2	-1	–	-1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-8	-2
Nettoabnahme	-8	-1
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	-1	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	-5	-5
Nettoabnahme	-5	-5
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	33	91
Eingelöst	-130	-131
Nettoabnahme	-97	-40
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	142	71
Eingelöst	-178	-80
Nettoabnahme	-36	-9
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	9	22
Eingelöst	-21	-87
Nettoabnahme	-12	-65
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)		
Verkauft	15	32
Eingelöst	-38	-108
Nettoabnahme	-23	-76
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	7
Eingelöst	-6	-154
Nettoabnahme	-6	-147
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	-10	-1
Nettoabnahme	-9	-1
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	20	9
Eingelöst	-63	-168
Nettoabnahme	-43	-159
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	43	–
Eingelöst	-20	-338
Nettozunahme/(-abnahme)	23	-338
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	1
Eingelöst	-6	-7
Nettoabnahme	-4	-6
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Eingelöst	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-7	-5
Nettoabnahme	-7	-4
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	187	107
Eingelöst	-38	-41
Nettozunahme	149	66
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	5	11
Eingelöst	–	-20
Nettozunahme/(-abnahme)	5	-9
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	2	1
Eingelöst	-3	-1
Nettoabnahme	-1	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	–	-2
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-3	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	11.942	176
Eingelöst	-11.941	-176
Nettozunahme	1	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse E USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse F USD, thesaurierend		
Eingelöst	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	4
Eingelöst	-4	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	4
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	4	1
Eingelöst	-1	-2
Nettozunahme/(-abnahme)	3	-1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	1.645	184
Eingelöst	-343	-14
Nettozunahme	1.302	170
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	592	20
Eingelöst	-268	-47
Nettozunahme/(-abnahme)	324	-27
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	7	6
Eingelöst	–	-57
Nettozunahme/(-abnahme)	7	-51
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-15
Nettoabnahme	–	-15
Klasse Premier SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-151.908
Nettoabnahme	–	-151.908
Klasse LM USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	-43
Nettoabnahme	–	-43
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1.795
Eingelöst	-3.246	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3.246	1.795
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	–	2
Nettozunahme	–	2
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	11	18
Eingelöst	-8	-15
Nettozunahme	3	3

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD, ausschüttend (M)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-1	-1
Nettozunahme	-	1
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	10	11.856
Eingelöst	-41	-11.977
Nettoabnahme	-31	-121
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-9	-2
Nettoabnahme	-9	-1
Klasse E USD, thesaurierend		
Eingelöst	-	-2
Nettoabnahme	-	-2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	-	18
Eingelöst	-3	-23
Nettoabnahme	-3	-5
Klasse F USD, ausschüttend (M)		
Eingelöst	-	-9
Nettoabnahme	-	-9
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	-	10
Eingelöst	-	-7
Nettozunahme	-	3
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	2	3
Eingelöst	-3	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	2
Klasse Premier USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Eingelöst	-	-7
Nettoabnahme	-	-7
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	56	83
Eingelöst	-56	-940
Nettoabnahme	-	-857
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		
Verkauft	1	-
Eingelöst	-	-5
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-5
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	3	2
Nettozunahme	3	2
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-3	-5
Nettoabnahme	-2	-3
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		
Verkauft	4	99
Eingelöst	-6	-1.579
Nettoabnahme	-2	-1.480
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	418	1529
Eingelöst	-566	-495
Netto-(Abgang)/-Zugang	-148	1034
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	9	14
Eingelöst	-11	-3
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	11
Klasse A USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	58	208
Eingelöst	-163	-47
Netto-(Abgang)/-Zugang	-105	161
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	133	1486
Eingelöst	-568	-404
Netto-(Abgang)/-Zugang	-435	1082
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	232	773
Eingelöst	-489	-58
Netto-(Abgang)/-Zugang	-257	715

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	-	51
Eingelöst	-2	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	50
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	4	63
Eingelöst	-29	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-25	63
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	21	80
Eingelöst	-23	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	80
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	115	322
Eingelöst	-201	-59
Netto-(Abgang)/-Zugang	-86	263
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	67	176
Eingelöst	-59	-50
Nettozunahme	8	126
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	125	229
Eingelöst	-89	-133
Nettozunahme	36	96
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	3	32
Eingelöst	-6	-2
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	30
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	13	49
Eingelöst	-14	-14
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	35
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	11	28
Eingelöst	-14	-2
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	26
Klasse A HKD, thesaurierend		
Verkauft	4	64
Eingelöst	-14	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	63
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	21	1.610
Eingelöst	-517	-136
Netto-(Abgang)/-Zugang	-496	1.474
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	50.704	5.682
Eingelöst	-14.808	-258
Nettozunahme	35.896	5.424
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	45172	59.557
Eingelöst	-52.806	-14.289
Netto-(Abgang)/-Zugang	-7.634	45.268
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	10.980	12.877
Eingelöst	-14.908	-481
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3.928	12.396
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	121	401
Eingelöst	-265	-27
Netto-(Abgang)/-Zugang	-144	374
Klasse C USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	107	13
Eingelöst	-4	-2
Nettozunahme	103	11
Klasse A CZK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	-
Nettozunahme	1	-
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	69	239
Eingelöst	-78	-44
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	195
Klasse E USD, ausschüttend (D)		
Verkauft	4	8
Eingelöst	-3	-3
Nettozunahme	1	5

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)				
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	10	40		
Eingelöst	-9	-9		
Nettozunahme	1	31		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	78	422		
Eingelöst	-205	-56		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-127	366		
Klasse F USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	12	61		
Eingelöst	-21	-12		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-9	49		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	19	160		
Eingelöst	-60	-18		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-41	142		
Klasse X USD, ausschüttend (D)				
Verkauft	4	1		
Eingelöst	-1	-1		
Nettozunahme	3	-		
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	43	324		
Eingelöst	-96	-149		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-53	175		
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	11		
Eingelöst	-11	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	11		
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)				
Verkauft	-	30		
Eingelöst	-24	-2		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-24	28		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	59	416		
Eingelöst	-226	-77		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-167	339		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	-	4		
Eingelöst	-2	-1		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	3		
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	11	121		
Eingelöst	-33	-92		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-22	29		
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	13	68		
Eingelöst	-35	-16		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-22	52		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	121	910		
Eingelöst	-375	-113		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-254	797		
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	91	233		
Eingelöst	-79	-57		
Nettozunahme	12	176		
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	4	135		
Eingelöst	-1	-17		
Nettozunahme	3	118		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	495	1312		
Eingelöst	-716	-392		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-221	920		
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	310	400		
Eingelöst	-207	-33		
Nettozunahme	103	367		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	67	20		
Eingelöst	-15	-5		
Nettozunahme	52	15		
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	1	650		
Eingelöst	-61	-1.616		
Nettoabnahme	-60	-966		
Klasse S USD, thesaurierend				
Verkauft	193	1.990		
Eingelöst	-1.031	-452		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-838	1.538		
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)				
Verkauft	-	3		
Nettozunahme	-	3		
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	178	492		
Eingelöst	-264	-79		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-86	413		
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	5	72		
Eingelöst	-3	-65		
Nettozunahme	2	7		
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	2	15		
Eingelöst	-13	-14		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-11	1		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Verkauft	215	-		
Eingelöst	-100	-		
Nettozunahme	115	-		
Klasse LM USD, ausschüttend (M)				
Verkauft	15	87		
Eingelöst	-19	-8		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	79		
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)				
Verkauft	1.038	418		
Eingelöst	-84	-		
Nettozunahme	954	418		
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	169	16		
Eingelöst	-151	-9		
Nettozunahme	18	7		
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	1	2		
Eingelöst	-	-19		
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-17		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	17	136		
Eingelöst	-63	-43		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-46	93		
Klasse LM USD, thesaurierend				
Eingelöst	-	-58		
Nettoabnahme	-	-58		
Klasse S BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	-	22		
Eingelöst	-	-125		
Nettoabnahme	-	-103		
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]				
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	-	1		
Nettozunahme	-	1		
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]				
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	104	9.442		
Eingelöst	-5.710	-10.719		
Nettoabnahme	-5.606	-1.277		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Zurückgenommen	-	-145		
Nettoabnahme	-	-145		
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	-	1.584		
Eingelöst	-237	-4.864		
Nettoabnahme	-237	-3.280		
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]				
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] – (Fortsetzung)					
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft	148	–	Verkauft	89	36
Nettozunahme	148	–	Eingelöst	-94	-3
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	1	–	Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	33
Nettozunahme	1	–	Klasse Premier USD, thesaurierend		
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	2	1	Verkauft	370	444
Nettozunahme	2	1	Eingelöst	-203	-268
FTGF ClearBridge Value Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	402	920	Nettozunahme	167	176
Eingelöst	-370	-266	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Nettozunahme	32	654	Verkauft	11	2
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	19	63	Eingelöst	-1	–
Eingelöst	-23	-43	Nettozunahme	10	2
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	20	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	55	1	Verkauft	508	283
Eingelöst	-29	-1	Eingelöst	-231	-16
Nettozunahme	26	–	Nettozunahme	277	267
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	54	67	Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-44	-28	Verkauft	124	399
Nettozunahme	10	39	Eingelöst	-185	-172
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)					
Verkauft	1	–	Netto-(Abgang)/-Zugang	-61	227
Nettozunahme	1	–	LM Klasse USD, ausschüttend (A)		
Klasse A GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	–	3	Verkauft	7	140
Eingelöst	–	-3	Eingelöst	-48	-8
Nettozunahme	–	–	Netto-(Abgang)/-Zugang	-41	132
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	262	1.920	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Eingelöst	-573	-931	Klasse A USD thesaurierend		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-311	989	Verkauft	19	37
Klasse A SGD, thesaurierend					
Verkauft	1.549	3.159	Eingelöst	-26	-27
Eingelöst	-1.320	-1.532	Netto-(Abgang)/-Zugang	-7	10
Nettozunahme	229	1.627	Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	43	101	Verkauft	3	8
Eingelöst	-27	-49	Eingelöst	-11	-12
Nettozunahme	16	52	Nettoabnahme	-8	-4
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	3	5	Klasse A EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-2	-2	Verkauft	2	1
Nettozunahme	1	3	Eingelöst	–	-1
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	32	37	Nettozunahme	2	–
Eingelöst	-18	-10	Klasse B USD, thesaurierend		
Nettozunahme	14	27	Eingelöst	–	-1
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	40	93	Nettoabnahme	–	-1
Eingelöst	-35	-28	Klasse B USD, ausschüttend (A)		
Nettozunahme	5	65	Eingelöst	-2	-1
Klasse F USD ausschüttend (A)					
Verkauft	–	15	Nettoabnahme	-2	-1
Eingelöst	-14	-1	Klasse C USD, thesaurierend		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-14	14	Verkauft	3	7
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	5	–	Eingelöst	-8	-11
Eingelöst	-4	–	Nettoabnahme	-5	-4
Nettozunahme	1	–	Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	19	246	Verkauft	3	4
Eingelöst	-78	-308	Eingelöst	-6	-9
Nettoabnahme	-59	-62	Nettoabnahme	-3	-5
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	–	–	Klasse E USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	–	Verkauft	5	16
Nettozunahme	1	–	Eingelöst	-11	-14
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Netto-(Abgang)/-Zugang	-6	2
Eingelöst	-26	-62	Klasse F USD, thesaurierend		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Verkauft	15	43
Klasse X EUR, thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–	Eingelöst	-28	-47
Nettoabnahme	-1	–	Nettoabnahme	-13	-4
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Klasse F USD ausschüttend (A)		
Eingelöst	-26	-62	Verkauft	3	5
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Eingelöst	-2	-5
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Nettozunahme	1	–
Eingelöst	-26	-62	Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Eingelöst	–	-2
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Nettoabnahme	–	-2
Eingelöst	-26	-62	Klasse X EUR, thesaurierend		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Zurückgenommen	-1	–
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Nettoabnahme	-1	–
Eingelöst	-26	-62	Klasse Premier USD, thesaurierend		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Verkauft	18	73
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	18	73	Eingelöst	-26	-62
Eingelöst	-26	-62	Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	11	Klasse Premier USD, thesaurierend		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund – (Fortsetzung)					
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-3	–			
Nettoabnahme	-3	–			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	23	2			
Eingelöst	-2	-51			
Nettozunahme/(-abnahme)	21	-49			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	11	46			
Eingelöst	-8	-14			
Nettozunahme	3	32			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	–			
Eingelöst	-2	-4			
Nettoabnahme	-1	-4			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	3	1			
Eingelöst	-4	-2			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	-3			
Nettoabnahme	–	-3			
Klasse GA USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)					
Eingelöst	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	104	246			
Eingelöst	-173	-275			
Nettoabnahme	-69	-29			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	23	52			
Eingelöst	-32	-69			
Nettoabnahme	-9	-17			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	33	69			
Eingelöst	-28	-81			
Nettozunahme/(-abnahme)	5	-12			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	24	33			
Eingelöst	-55	-57			
Nettoabnahme	-31	-24			
Klasse B USD, thesaurierend					
Eingelöst	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	5	49			
Eingelöst	-9	-58			
Nettoabnahme	-4	-9			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	5			
Eingelöst	-9	-7			
Nettoabnahme	-8	-2			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	9	22			
Eingelöst	-18	-26			
Nettoabnahme	-9	-4			
Klasse E USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	210	319			
Eingelöst	-209	-253			
Nettozunahme	1	66			
Klasse F USD ausschüttend (A)					
Verkauft	5	39			
Eingelöst	-40	-37			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-35	2			
Klasse U USD, thesaurierend					
Verkauft	442	509			
Eingelöst	-742	-610			
Nettoabnahme	-300	-101			
Klasse U EUR, thesaurierend					
Verkauft	22	187			
Eingelöst	-350	-165			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-328	22			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	54	60			
Eingelöst	-40	-63			
Nettozunahme/(-abnahme)	14	-3			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	8	26			
Eingelöst	-27	-93			
Nettoabnahme	-19	-67			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	4	6			
Eingelöst	-2	-14			
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-8			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	15	12			
Eingelöst	-14	-24			
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-12			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	645	449			
Eingelöst	-810	-811			
Nettoabnahme	-165	-362			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	13	24			
Eingelöst	-18	-14			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	10			
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	–	728			
Eingelöst	-761	-624			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-761	104			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	107	46			
Eingelöst	-94	-44			
Nettozunahme	13	2			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	29	167			
Eingelöst	-177	-321			
Nettoabnahme	-148	-154			
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	10			
Eingelöst	-2	-5			
Nettozunahme	3	5			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	58	98			
Eingelöst	-108	-85			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-50	13			
Klasse LM USD, thesaurierend					
Verkauft	430	172			
Eingelöst	-472	-76			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-42	96			
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Eingelöst	–	-1			
Nettoabnahme	–	-1			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	1	2			
Eingelöst	-2	-3			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	51	67			
Eingelöst	-103	-129			
Nettoabnahme	-52	-62			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	6	28			
Eingelöst	-12	-38			
Nettoabnahme	-6	-10			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund – (Fortsetzung)					
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	35	14			
Eingelöst	-33	-61			
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-47			
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	43	99			
Eingelöst	-44	-70			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	29			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-4			
Nettoabnahme	-	-3			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	2	3			
Eingelöst	-5	-10			
Nettoabnahme	-3	-7			
Klasse A GBP, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse A HKD, thesaurierend					
Eingelöst	-2	-			
Nettoabnahme	-2	-			
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	83	924			
Eingelöst	-551	-1.204			
Nettoabnahme	-468	-280			
Klasse B USD, thesaurierend					
Eingelöst	-1	-2			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse B USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	-3	-2			
Nettoabnahme	-3	-2			
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	4			
Eingelöst	-10	-8			
Nettoabnahme	-9	-4			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	1	12			
Eingelöst	-10	-21			
Nettoabnahme	-9	-9			
Klasse E USD, thesaurierend					
Verkauft	2	8			
Eingelöst	-25	-9			
Nettoabnahme	-23	-1			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	6	4			
Eingelöst	-10	-12			
Nettoabnahme	-4	-8			
Klasse F USD ausschüttend (A)					
Verkauft	1	8			
Eingelöst	-4	-6			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	2			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	8	8			
Eingelöst	-15	-22			
Nettoabnahme	-7	-14			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	-	2			
Eingelöst	-1	-3			
Nettoabnahme	-1	-1			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Eingelöst	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	4	-			
Eingelöst	-4	-			
Nettozunahme	-	-			
Klasse X GBP, thesaurierend					
Verkauft	3	15			
Eingelöst	-24	-55			
Nettoabnahme	-21	-40			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	40	115			
Eingelöst	-718	-358			
Nettoabnahme	-678	-243			
Klasse Premier EUR, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-3			
Nettoabnahme	-	-2			
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-1	-3			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-1	-3			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1			
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)					
Verkauft	5	7			
Eingelöst	-56	-57			
Nettoabnahme	-51	-50			
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	-	7			
Eingelöst	-33	-4			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-33	3			
Klasse A (G) USD, thesaurierend					
Verkauft	6	4			
Eingelöst	-13	-10			
Nettoabnahme	-7	-6			
Klasse L (G) USD, thesaurierend					
Eingelöst	-3	-4			
Nettoabnahme	-3	-4			
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	21	9			
Eingelöst	-11	-7			
Nettozunahme	10	2			
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	15	11			
Eingelöst	-9	-17			
Nettozunahme/(-abnahme)	6	-6			
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Eingelöst	-	-1			
Nettoabnahme	-	-1			
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	15	3			
Eingelöst	-16	-5			
Nettoabnahme	-1	-2			
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-4	-			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	1			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	1	9			
Eingelöst	-5	-9			
Nettoabnahme	-4	-			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	-	1			
Eingelöst	-	-1			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)					
Verkauft	3	-			
Eingelöst	-3	-			
Nettozunahme	-	-			
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus					
Verkauft	3	45			
Eingelöst	-55	-43			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-52	2			
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft	1.444	537			
Eingelöst	-1.127	-59			
Nettozunahme	317	478			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)					
Klasse C USD, thesaurierend					
Verkauft	1	1			
Eingelöst	-1	-			
Nettozunahme	-	1			
Klasse C USD, ausschüttend (A)					
Eingelöst	-1	-			
Nettoabnahme	-1	-			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	6	8			
Eingelöst	-15	-15			
Nettoabnahme	-9	-7			
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft	96	296			
Eingelöst	-72	-32			
Nettozunahme	24	264			
Klasse A USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	27	52			
Eingelöst	-23	-18			
Nettozunahme	4	34			
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	66	201			
Eingelöst	-160	-48			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-94	153			
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft	50	-			
Eingelöst	-1	-			
Nettozunahme	49	-			
Klasse A SEK, thesaurierend					
Verkauft	120	5.052			
Eingelöst	-416	-5.408			
Nettoabnahme	-296	-356			
Klasse F USD, thesaurierend					
Verkauft	16	21			
Eingelöst	-15	-			
Nettozunahme	1	21			
Klasse X USD thesaurierend					
Verkauft	55	301			
Eingelöst	-100	-224			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-45	77			
Klasse X USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	2	5			
Eingelöst	-4	-2			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	3			
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	17	11			
Eingelöst	-11	-12			
Nettozunahme/(-abnahme)	6	-1			
Klasse X EUR, thesaurierend					
Verkauft	-	24			
Eingelöst	-1	-17			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	7			
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	14	28			
Eingelöst	-12	-39			
Nettozunahme/(-abnahme)	2	-11			
Klasse X GBP thesaurierend					
Verkauft	1.317	688			
Eingelöst	-547	-138			
Nettozunahme	770	550			
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft	342	1.449			
Eingelöst	-781	-783			
Netto-(Abgang)/-Zugang	-439	666			
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)					
Verkauft	8	116			
Eingelöst	-6	-			
Nettozunahme	2	116			
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft	31	9			
Eingelöst	-14	-1			
Nettozunahme	17	8			
Klasse Premier GBP, thesaurierend					
Verkauft			73	14	
Eingelöst			-55	-4	
Nettozunahme			18	10	
Klasse S USD, thesaurierend					
Verkauft			2.151	4.695	
Eingelöst			-2.265	-2.656	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-114	2.039	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			6	50	
Eingelöst			-43	-3	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-37	47	
Klasse S EUR, thesaurierend					
Verkauft			-	178	
Nettozunahme			-	178	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			118	232	
Eingelöst			-55	-263	
Nettozunahme/(-abnahme)			63	-31	
Klasse S GBP, thesaurierend					
Verkauft			339	580	
Eingelöst			-355	-531	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-16	49	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)					
Verkauft			24	63	
Eingelöst			-44	-13	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-20	50	
Klasse LM EUR, thesaurierend					
Verkauft			138	177	
Eingelöst			-7	-4	
Nettozunahme			131	173	
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]					
Klasse Premier USD, thesaurierend					
Verkauft			16	36	
Eingelöst			-27	-3	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-11	33	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]					
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)					
Verkauft			9.720	5.237	
Eingelöst			-9.793	-4.749	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-73	488	
Klasse A USD thesaurierend					
Verkauft			3.013	2.970	
Eingelöst			-3.756	-318	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-743	2.652	
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			4.500	3.390	
Eingelöst			-5.071	-4.157	
Nettoabnahme			-571	-767	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)					
Verkauft			95	165	
Eingelöst			-111	-175	
Nettoabnahme			-16	-10	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			711	965	
Eingelöst			-1.182	-360	
Netto-(Abgang)/-Zugang			-471	605	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus					
Verkauft			16.667	4.818	
Eingelöst			-5.439	-2.681	
Nettozunahme			11.228	2.137	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)					
Verkauft			406	341	
Eingelöst			-288	-55	
Nettozunahme			118	286	
Klasse A EUR, thesaurierend					
Verkauft			7.976	3.000	
Eingelöst			-3.080	-3.273	
Nettozunahme/(-abnahme)			4.896	-273	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)					
Verkauft			45	-	
Nettozunahme			45	-	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum		Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)				
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	290	162		
Eingelöst	-185	-196		
Nettozunahme/(-abnahme)	105	-34		
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	8.620	10.608		
Eingelöst	-8.849	-7.189		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-229	3419		
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	64	61		
Eingelöst	-16	-85		
Nettozunahme/(-abnahme)	48	-24		
Klasse C USD, thesaurierend				
Verkauft	57	384		
Eingelöst	-95	-68		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-38	316		
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	213	129		
Eingelöst	-93	-39		
Nettozunahme	120	90		
Klasse E USD, thesaurierend				
Verkauft	228	478		
Eingelöst	-375	-139		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-147	339		
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	556	140		
Eingelöst	-54	-145		
Nettozunahme/(-abnahme)	502	-5		
Klasse F USD, thesaurierend				
Verkauft	448	32		
Eingelöst	-186	-5		
Nettozunahme	262	27		
Klasse X USD thesaurierend				
Verkauft	128	-		
Eingelöst	-4	-48		
Nettozunahme/(-abnahme)	124	-48		
Klasse X USD, ausschüttend (A)				
Verkauft	8	3		
Eingelöst	-5	-1		
Nettozunahme	3	2		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)				
Verkauft	969	239		
Eingelöst	-318	-26		
Nettozunahme	651	213		
Klasse X EUR, thesaurierend				
Verkauft	3.299	1.582		
Eingelöst	-1.267	-2.358		
Nettozunahme/(-abnahme)	2.032	-776		
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)				
Verkauft	42	67		
Eingelöst	-75	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-33	67		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)				
Verkauft	89	98		
Eingelöst	-21	-26		
Nettozunahme	68	72		
Klasse Premier USD, thesaurierend				
Verkauft	9.228	573		
Eingelöst	-5.090	-97		
Nettozunahme	4.138	476		
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	567	543		
Eingelöst	-1.620	-343		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1.053	200		
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)				
Verkauft	133			
Eingelöst	-656	-		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-523	137		
Premier Klasse CAD, ausschüttend (Q) Plus (e)				
Verkauft	14	26		
Eingelöst	-825	-762		
Nettoabnahme	-811	-736		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)				
Verkauft	26	10		
Eingelöst	-297	-78		
Nettoabnahme	-271	-68		
Klasse Premier EUR, thesaurierend				
Verkauft	12.764	8.130		
Eingelöst	-3.585	-11.807		
Nettozunahme/(-abnahme)	9.179	-3.677		
Klasse Premier GBP, thesaurierend				
Verkauft	13	6		
Eingelöst	-355	-130		
Nettoabnahme	-342	-124		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)				
Verkauft	360	94		
Eingelöst	-586	-2.406		
Nettoabnahme	-226	-2.312		
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)				
Verkauft	2.346	4.282		
Eingelöst	-2.310	-1.980		
Nettozunahme	36	2.302		
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert)				
Verkauft	-	29		
Eingelöst	-	-654		
Nettoabnahme	-	-625		
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^{^e}				
Klasse A USD thesaurierend				
Zurückgenommen	-3	-		
Nettoabnahme	-3	-		
Klasse A USD, ausschüttend (Q)				
Eingelöst	-2	-		
Nettoabnahme	-2	-		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	-7	-		
Nettoabnahme	-7	-		
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)				
Zurückgenommen	-7	-		
Nettoabnahme	-7	-		
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)				
Eingelöst	-9	-		
Nettoabnahme	-9	-		
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund				
Klasse A USD thesaurierend				
Verkauft	203	173		
Eingelöst	-92	-4		
Nettozunahme	111	169		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)				
Verkauft	187	759		
Eingelöst	-224	-52		
Netto-(Abgang)/-Zugang	-37	707		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus				
Verkauft	543	306		
Eingelöst	-143	-32		
Nettozunahme	400	274		
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	100	83		
Eingelöst	-36	-8		
Nettozunahme	64	75		
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	97	19		
Eingelöst	-12	-		
Nettozunahme	85	19		
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)				
Verkauft	1	-		
Nettozunahme	1	-		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	64	34		
Eingelöst	-9	-		
Nettozunahme	55	34		
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus				
Verkauft	50	1		
Eingelöst	-3	-		
Nettozunahme	47	1		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	63	135
Eingelöst	-81	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-18	135
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	98.637	45.506
Eingelöst	-38.661	-8.680
Nettozunahme	59.976	36.826
Klasse U USD, thesaurierend		
Verkauft	48	-
Nettozunahme	48	-
Klasse U EUR, thesaurierend		
Verkauft	86	-
Nettozunahme	86	-
Klasse U EUR, ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	1	-
Nettozunahme	1	-
Klasse U GBP, thesaurierend		
Verkauft	27	-
Nettozunahme	27	-
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	577	16
Eingelöst	-395	-13
Nettozunahme	182	3
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	5	-
Eingelöst	-1	-
Nettozunahme	4	-
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	23	15
Eingelöst	-4	-10
Nettozunahme	19	5
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	9	1
Eingelöst	-4	-
Nettozunahme	5	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	97	46
Eingelöst	-116	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-19	46
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1.047	48
Eingelöst	-438	-
Nettozunahme	609	48
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		
Verkauft	367	2
Eingelöst	-25	-1
Nettozunahme	342	1
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	322	2
Eingelöst	-43	-
Nettozunahme	279	2
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	101	15
Eingelöst	-30	-
Nettozunahme	71	15
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	118	811
Eingelöst	-244	-889
Nettoabnahme	-126	-78
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	5	28
Eingelöst	-10	-150
Nettoabnahme	-5	-122
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	34	132
Eingelöst	-36	-164
Nettoabnahme	-2	-32
Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	54	452
Eingelöst	-42	-516
Nettozunahme/(-abnahme)	12	-64

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	61	170
Eingelöst	-53	-205
Nettozunahme/(-abnahme)	8	-35
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	41	262
Eingelöst	-74	-211
Netto-(Abgang)/-Zugang	-33	51
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	5	6
Eingelöst	-6	-4
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	2
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-2	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1
Klasse A GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	3
Eingelöst	-	-3
Nettozunahme	-	-
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	15	51
Eingelöst	-15	-74
Nettoabnahme	-	-23
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	3.936	12.298
Eingelöst	-3.306	-16.831
Nettozunahme/(-abnahme)	630	-4.533
Klasse A SGD, thesaurierend		
Verkauft	857	5.184
Eingelöst	-914	-6.790
Nettoabnahme	-57	-1.606
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	9	33
Eingelöst	-13	-8
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	25
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-1	-1
Nettozunahme	-	-
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	13	33
Eingelöst	-16	-30
Netto-(Abgang)/-Zugang	-3	3
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	2	10
Eingelöst	-1	-8
Nettozunahme	1	2
Klasse E EUR thesaurierend		
Verkauft	3	7
Eingelöst	-2	-5
Nettozunahme	1	2
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	5	69
Eingelöst	-37	-59
Netto-(Abgang)/-Zugang	-32	10
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-	-3
Nettoabnahme	-	-2
Klasse R EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-	-2
Nettoabnahme	-	-1
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	149	352
Eingelöst	-93	-508
Nettozunahme/(-abnahme)	56	-156
Klasse X USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-2	-
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	87	293
Eingelöst	-130	-280
Netto-(Abgang)/-Zugang	-43	13
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	14	170
Eingelöst	-54	-232
Nettoabnahme	-40	-62
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	34	110
Eingelöst	-37	-117
Nettoabnahme	-3	-7
Klasse X GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	16
Eingelöst	-5	-15
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	172	666
Eingelöst	-253	-1.005
Nettoabnahme	-81	-339
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	-	467
Eingelöst	-338	-105
Netto-(Abgang)/-Zugang	-338	362
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	27	17
Eingelöst	-7	-128
Nettozunahme/(-abnahme)	20	-111
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	68	133
Eingelöst	-97	-49
Netto-(Abgang)/-Zugang	-29	84
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Verkauft	22	106
Eingelöst	-73	-428
Nettoabnahme	-51	-322
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	10	100
Eingelöst	-48	-33
Netto-(Abgang)/-Zugang	-38	67
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	13	94
Eingelöst	-33	-106
Nettoabnahme	-20	-12
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	17
Eingelöst	-7	-16
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	1
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	5
Eingelöst	-1	-10
Nettoabnahme	-	-5
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	13
Eingelöst	-2	-14
Nettoabnahme	-	-1
Klasse A SEK, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	5	7
Eingelöst	-5	-8
Nettoabnahme	-	-1
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	1	3
Eingelöst	-2	-3
Nettoabnahme	-1	-
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	3
Eingelöst	-	-5
Nettoabnahme	-	-2
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	-	5
Eingelöst	-	-5
Nettozunahme	-	-

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	7	24
Eingelöst	-6	-11
Nettozunahme	1	13
Klasse F USD ausschüttend (A)		
Verkauft	-	2
Eingelöst	-	-1
Nettozunahme	-	1
Klasse R USD, thesaurierend		
Eingelöst	-	-1
Nettoabnahme	-	-1
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	-	18
Eingelöst	-2	-17
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	1
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-1	-5
Nettoabnahme	-1	-4
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	4	8
Eingelöst	-14	-9
Nettoabnahme	-10	-1
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Verkauft	1	-
Eingelöst	-1	-
Nettozunahme	-	-
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	-2	-
Nettoabnahme	-2	-
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	-	50
Nettozunahme	-	50
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^{^y}		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-10	-3
Nettoabnahme	-9	-1
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	-	3
Eingelöst	-7	-3
Nettoabnahme	-7	-
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-5	-2
Nettoabnahme	-5	-1
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	-	22
Eingelöst	-48	-20
Netto-(Abgang)/-Zugang	-48	2
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	-	3
Eingelöst	-23	-10
Nettoabnahme	-23	-7
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	-	9
Eingelöst	-11	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-11	8
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	-	1
Eingelöst	-2	-1
Nettoabnahme	-2	-
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-1	-
Nettoabnahme	-1	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^α – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	2
Eingelöst	-4	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-4	1
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	41	3.874
Eingelöst	-431	-3.692
Netto-(Abgang)/-Zugang	-390	182
Klasse B USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD, thesaurierend		
Eingelöst	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	-8	–
Nettoabnahme	-8	–
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	2
Eingelöst	-1	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Eingelöst	-3	-17
Nettoabnahme	-3	-14
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-15
Nettoabnahme	–	-15
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	12
Eingelöst	-18	-2
Netto-(Abgang)/-Zugang	-18	10
Klasse LM USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-39
Nettoabnahme	–	-38
Klasse LM EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-15	-4
Nettoabnahme	-15	-4
Klasse A (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	-10	-1
Nettoabnahme	-10	-1
Klasse L (G) USD, thesaurierend		
Eingelöst	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse GA USD, thesaurierend		
Eingelöst	-5	-1
Nettoabnahme	-5	-1
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Verkauft	–	6
Eingelöst	-62	-12
Nettoabnahme	-62	-6
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	5	3
Eingelöst	-6	-7
Nettoabnahme	-1	-4
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	2	4
Eingelöst	-2	-5
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	4	7
Eingelöst	-6	-28
Nettoabnahme	-2	-21
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	54	2
Eingelöst	-39	-14
Nettozunahme/(-abnahme)	15	-12

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	16	–
Eingelöst	-16	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	2	3
Eingelöst	-3	-1
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	2
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	93
Eingelöst	-29	-119
Nettoabnahme	-27	-26
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	21	10
Eingelöst	-15	-65
Nettozunahme/(-abnahme)	6	-55
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-2	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse E USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	-66	-16
Nettoabnahme	-65	-16
Klasse GA USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^α		
Klasse A USD thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A USD, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	-90
Nettoabnahme	–	-90
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α		
Klasse A USD thesaurierend		
Zurückgenommen	-12	–
Nettoabnahme	-12	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	-3	-5
Nettoabnahme	-3	-5
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Eingelöst	-6	-4
Nettoabnahme	-6	-4
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus		
Eingelöst	-13	-80
Nettoabnahme	-13	-80
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	1	522
Eingelöst	-69	-498
Netto-(Abgang)/-Zugang	-68	24
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	–	15
Eingelöst	-25	-9
Netto-(Abgang)/-Zugang	-25	6
Klasse GA USD, thesaurierend		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-20	-1
Nettoabnahme	-20	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^α – (Fortsetzung)		
Klasse GA EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-5	-1
Nettoabnahme	-5	-1
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse GE EUR, thesaurierend		
Eingelöst	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^α		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	4	–
Eingelöst	-3	–
Nettozunahme	1	–
Klasse M GBP, ausschüttend (A)		
Verkauft	3	21
Eingelöst	-16	-28
Nettoabnahme	-13	-7
Klasse M USD ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Eingelöst	–	-3.307
Nettozunahme/(-abnahme)	1	-3.307
Klasse M EUR, ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-9
Nettoabnahme	–	-9
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	15	179
Eingelöst	-131	-210
Nettoabnahme	-116	-31
Klasse Premier GBP, thesaurierend		
Eingelöst	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund^α		
Klasse A (PF) USD, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Verkauft	–	50
Eingelöst	–	-588
Nettoabnahme	–	-538
Klasse A (PF) EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	-28
Nettoabnahme	–	-28
Klasse A (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Eingelöst	–	-238
Nettoabnahme	–	-238
Klasse M (PF) USD ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	-195
Nettoabnahme	–	-195
Klasse M (PF) EUR, thesaurierend		
Eingelöst	–	-37
Nettoabnahme	–	-37
Klasse M (PF) EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	–	7
Eingelöst	–	-589
Nettoabnahme	–	-582
Klasse M (PF) GBP, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	-85
Nettoabnahme	–	-85
Klasse M (PF) NOK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse M (PF) SEK, ausschüttend (A) (abgesichert)		
Eingelöst	–	-102
Nettoabnahme	–	-102
Klasse Premier (PF) USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	38
Eingelöst	–	-173
Nettoabnahme	–	-135
Klasse Premier (PF) BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	3
Eingelöst	–	-155
Nettoabnahme	–	-152

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^α		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	8	31
Eingelöst	-13	-5
Netto-(Abgang)/-Zugang	-5	26
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	434
Eingelöst	-52	-217
Netto-(Abgang)/-Zugang	-52	217
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	26	16
Eingelöst	-11	-7
Nettozunahme	15	9
Klasse C USD, thesaurierend		
Verkauft	–	5
Eingelöst	–	-2
Nettozunahme	–	3
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	1	34
Eingelöst	-11	-14
Netto-(Abgang)/-Zugang	-10	20
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	–	3
Nettozunahme	–	3
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	1	1
Eingelöst	-1	–
Nettozunahme	–	1
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	6	6
Eingelöst	-2	-1
Nettozunahme	4	5
Klasse X GBP, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-1	-2
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	54	129
Eingelöst	-161	-11
Netto-(Abgang)/-Zugang	-107	118
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	–	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	–	78
Eingelöst	-8	-303
Nettoabnahme	-8	-225
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	616	815
Eingelöst	-294	-268
Nettozunahme	322	547
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	2	5
Eingelöst	-18	-86
Nettoabnahme	-16	-81
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	3	3
Nettozunahme	3	3
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	48	147
Eingelöst	-53	-167
Nettoabnahme	-5	-20

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

Aufstellung über die Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens – (Fortsetzung)

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	3
Eingelöst	-2	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-2	3
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		
Verkauft	–	89
Eingelöst	-807	-98
Nettoabnahme	-807	-9
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	2	8
Eingelöst	–	-5
Nettozunahme	2	3
Klasse D USD, thesaurierend		
Eingelöst	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse X AUD, thesaurierend		
Verkauft	1	2
Eingelöst	-1	-1
Nettozunahme	–	1
Klasse X USD thesaurierend		
Verkauft	3	–
Eingelöst	-2	–
Nettozunahme	1	–
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Nettozunahme	–	1
Klasse LM AUD, thesaurierend		
Eingelöst	-5	-12
Nettoabnahme	-5	-12
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend		
Verkauft	21	44
Eingelöst	-35	-13
Netto-(Abgang)/-Zugang	-14	31
Klasse E USD, thesaurierend		
Verkauft	2	2
Eingelöst	-1	-2
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD, thesaurierend		
Verkauft	81	94
Eingelöst	-36	-22
Nettozunahme	45	72
Klasse X USD thesaurierend		
Zurückgenommen	-6	–
Nettoabnahme	-6	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		
Verkauft	26	22
Eingelöst	-44	-19
Netto-(Abgang)/-Zugang	-18	3
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	1	15
Eingelöst	-14	-17
Nettoabnahme	-13	-2
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	138
Eingelöst	-45	-135
Netto-(Abgang)/-Zugang	-44	3
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	10	49
Eingelöst	-44	-8
Netto-(Abgang)/-Zugang	-34	41
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	1
Eingelöst	-1	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-1	1
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	3	8
Eingelöst	-11	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-8	8

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2023 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2022 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		
Verkauft	–	216
Eingelöst	-115	-25
Netto-(Abgang)/-Zugang	-115	191
Klasse Premier EUR, thesaurierend		
Verkauft	7	88
Eingelöst	-170	-36
Netto-(Abgang)/-Zugang	-163	52
Klasse S USD, thesaurierend		
Verkauft	5	–
Eingelöst	-5	-1.077
Nettoabnahme	–	-1.077
Klasse S EUR, thesaurierend		
Verkauft	113	1.249
Eingelöst	-567	-217
Netto-(Abgang)/-Zugang	-454	1.032
Klasse S GBP, thesaurierend		
Verkauft	136	1.273
Eingelöst	-142	–
Netto-(Abgang)/-Zugang	-6	1.273
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]π		
Klasse A EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	52	–
Eingelöst	-1	–
Nettozunahme	51	–
Klasse D EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse D EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse K EUR, thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse K EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X EUR, thesaurierend		
Verkauft	97	–
Nettozunahme	97	–
Klasse X EUR, ausschüttend (A)		
Verkauft	221	–
Nettozunahme	221	–

– Als „–“ angegebenen Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000. Es sind nur Klassen angegeben, bei denen im Geschäftsjahr Transaktionen erfolgt sind.

Siehe Erläuterung 14 – Bedeutende Ereignisse für Einzelheiten zu Namensänderungen der Fonds.

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

β Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

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

δ Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

ε Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.

λ Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.

μ Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.

π Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.

τ Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss

1. Allgemeines

Franklin Templeton Global Funds plc (die „Gesellschaft“, vormals Legg Mason Global Funds plc, umbenannt am 21. Februar 2023, um den Namen der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft, Franklin Templeton International Services S.à r.l., wiederzuspiegeln; Einzelheiten zu Änderungen von Fondsnamen finden Sie in Erläuterung 14 „Bedeutende Ereignisse“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital, die nach irischem Recht als Aktiengesellschaft gemäß dem Companies Act 2014, den European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der aktuellen Fassung) (die „UCITS Regulations“) und den OGAW-Vorschriften 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 Gründungsdokumente der Gesellschaft sehen vor, dass die Gesellschaft separate Anteilsklassen anbieten kann, die jeweils Anteile an einem Teilfonds (der „Fonds“ oder zusammen die „Fonds“) repräsentieren, der ein bestimmtes Anlageportfolio umfasst. Ein gesondertes Portfolio von Vermögenswerten für eine Anteilsklasse wird nicht geführt. Die von der Gesellschaft aufgelegten Fonds sind im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ dieses Berichts aufgeführt. Anlageziele und die Anlagepolitik für alle aktiven Fonds sind im Bericht des Verwaltungsrats aufgeführt.

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 2023 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 UCITS Regulations und der OGAW-Vorschriften der Zentralbank erstellt. Diese Regelungen entsprechen denjenigen, die bei der Erstellung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 angewendet wurden.

Grundlagen der Erstellung

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. Die Abschlüsse von 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[^], Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Total Return Investment Grade Bond Fund[^], Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], Legg Mason Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Legg Mason Battery March International Large Cap Fund[^], Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund[^], Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Japan Equity 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[^] and FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] wurde auf der Basis der Nichtfortführung der Geschäftstätigkeit erstellt, da diese Fonds während des laufenden und der vorangegangenen Geschäftsjahre bzw. nach dem Bilanzstichtag geschlossen wurden.

Das Format und bestimmte Formulierungen des Abschlusses wurden an die im Companies Act von 2014 enthaltenen angepasst, sodass sie nach Ansicht des Verwaltungsrats 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 Anleihen und Aktien und damit verbundene Derivate als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte bzw. finanzielle Verbindlichkeiten klassifiziert. Diese finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden als für Handelszwecke gehalten erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte und Verbindlichkeiten werden grundsätzlich gekauft oder eingegangen, um sie kurzfristig zu verkaufen oder zurückzukaufen. Derivate werden ebenfalls als zu Handelszwecken gehalten eingestuft, da die Gesellschaft keine Derivate als Sicherungsgeschäfte in einer Sicherungsbeziehung einstuft.

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

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsennotierte 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 Fonds bereitgestellt.

Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in Finanzinstrumente investieren, die nicht auf einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. in außerbörslich gehandelte Derivate). Der beizulegende Zeitwert wird mithilfe von Bewertungstechniken ermittelt. Die Gesellschaft nutzt eine Vielzahl von Methoden und trifft Annahmen, die auf den am jeweiligen Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen beruhen. Zu den angewendeten Methoden gehören der Rückgriff auf vergleichbare Transaktionen zu marktüblichen Konditionen, Discounted-Cashflow-Analysen und andere Bewertungstechniken, die üblicherweise von Marktteilnehmern verwendet 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, wenn es einen Markt für diese Instrumente gegeben hätte. Die Unterschiede könnten erheblich sein. Der Abschluss dieser Vereinbarungen ist in unterschiedlichem Ausmaß mit Kredit-, Rechts-, Markt- und Dokumentationsrisiken verbunden, die über die in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Beträge hinausgehen. Zu diesen Risiken gehört die Möglichkeit, dass es keinen liquiden Markt für diese Vereinbarungen gibt, dass die Vertragsparteien ihren Verpflichtungen nicht nachkommen oder sich über die Bedeutung der Vertragsbedingungen in den Verträgen nicht einig sind oder dass es zu ungünstigen Veränderungen der diesen Transaktionen zugrunde liegenden Zinssätze oder des Preises des Index oder des Wertpapiers kommt. Die am Jahresende verwendeten Preise, die von einem einzelnen Broker stammen oder auf Bewertungstechniken basieren, stellen die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende dar. Allerdings besteht hinsichtlich dieser Preise eine gewisse Unsicherheit. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Marktwert bei der jeweiligen Gegenpartei glattzustellen.

(b) Ansatz/Ausbuchung

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

(c) Preise von einem einzelnen Broker

Die am Jahresende verwendeten Preise, die von einem einzigen Broker bezogen werden, stellen die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende dar. Allerdings besteht hinsichtlich dieser Preise eine gewisse Unsicherheit. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Kurs bei der jeweiligen Gegenpartei glattzustellen. Die Werte der Wertpapiere für jeden Fonds, deren Preise zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 unter Rückgriff auf einen einzelnen Broker ermittelt wurden, sind der Erläuterung 12.1 (d) zu entnehmen.

(d) Bilanzierung von Anlagen

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

(e) Erträge aus Anlagen

In der Gesamtergebnisrechnung werden Zinserträge und -aufwendungen für alle Schuldtitel nach der Effektivzinzmethode ausgewiesen. Die Anlageverwalter überwachen ausstehende Zinserträge für sämtliche rückständigen Zinsforderungen. Die Konten wurden auf rückständige Zinsforderungen geprüft. Zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 wurden sämtliche Beträge als einbringbar ausgewiesen.

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

(f) Aufrechnung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden miteinander saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, falls es ein einklagbares Recht gibt, die anerkannten Beträge miteinander zu saldieren, und falls die Absicht besteht, auf Nettobasis abzuschließen, oder die Aktiva zu realisieren (verkaufen) und gleichzeitig einen Ausgleich für die Verbindlichkeiten zu finden. Per 28. Februar 2023 oder per 28. Februar 2022 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 zum Beispiel außerbörslich gehandelte Derivate. Der beizulegende Zeitwert solcher Instrumente wird anhand von Bewertungstechniken ermittelt, wie in Erläuterung 2(a) beschrieben. Wenn zur Ermittlung der beizulegenden Zeitwerte Bewertungstechniken (z. B. Modelle) verwendet werden, werden diese validiert und regelmäßig überprüft und mit dem Preis verglichen, der von einem unabhängigen Preisdienstleister bereitgestellt wird, sofern verfügbar.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

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

Soweit möglich, werden für die Modelle beobachtbare Daten verwendet. Allerdings ist es in Bereichen wie dem Kreditrisiko (sowohl das eigene als auch das der Gegenpartei), Volatilitäten und Korrelationen erforderlich, dass das Management Schätzungen vornimmt. Veränderungen der Annahmen in Bezug auf diese Faktoren könnten den ausgewiesenen beizulegenden Zeitwert von Finanzinstrumenten beeinflussen.

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, wenn es einen Markt für diese Instrumente gegeben hätte. Die Unterschiede könnten erheblich sein. Der Abschluss dieser Vereinbarungen ist in unterschiedlichem Ausmaß mit Kredit-, Rechts-, Markt- und Dokumentationsrisiken verbunden, die über die in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Beträge hinausgehen. Zu diesen Risiken gehört die Möglichkeit, dass es keinen liquiden Markt für diese Vereinbarungen gibt, dass die Vertragsparteien ihren Verpflichtungen nicht nachkommen oder sich über die Bedeutung der Vertragsbedingungen in den Verträgen nicht einig sind oder dass es zu ungünstigen Veränderungen der diesen Transaktionen zugrunde liegenden Zinssätze oder des Preises des Index oder des Wertpapiers kommt.

(h) Ausleihe von Wertpapieren

Bestimmte Fonds können Wertpapiere an Broker, Händler und andere Finanzorganisationen ausleihen, um zusätzliche Einnahmen zu erzielen. Jedes Wertpapierdarlehen ist mit Sicherheiten in einer Höhe besichert, die dem aktuellen Marktwert der ausgeliehenen Wertpapiere entspricht oder diesen übersteigt. Es besteht das Risiko einer Verzögerung beim Erhalt von Sicherheiten oder der Wiedereinlösung der ausgeliehenen Wertpapiere oder sogar eines Verlusts von Rechten an Sicherheiten, wenn der Kreditnehmer finanziell ausfällt.

Zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 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

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

(k) Transaktionskosten

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

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

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

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

(l) Währungsumrechnung

- Leit- und Darstellungswährung: Alle Posten, die in den Abschlüssen der Gesellschaft ausgewiesen sind, werden unter Verwendung der Währung ihres primären wirtschaftlichen Umfelds (die „Leitwährung“) bewertet. Das ist der US-Dollar für alle Fonds außer dem FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], bei denen die Leitwährung der Euro ist, beim FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], bei dem die Leitwährung das Pfund Sterling (britisches Pfund) ist, und beim Legg Mason Japan Equity Fund[^], bei dem die Leitwährung 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 erfassten und vereinnahmten oder gezahlten Einnahmen- und Ausgabenbeträgen als Wechselkursgewinne/-verluste in der Gesamtergebnisrechnung unter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten 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

Beim Abschluss von Futures-Kontrakten werden Einschusszahlungen geleistet, die in der Regel in bar erfolgen. Futures-Kontrakte werden auf der Grundlage ihrer täglich festgestellten Abrechnungspreise zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Veränderungen im Wert offener Futures-Kontrakte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste aus Futures-Kontrakten erfasst, bis die Kontrakte gekündigt werden. Zu diesem Zeitpunkt werden realisierte Gewinne und Verluste als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst und im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen. Die nicht realisierten Wertsteigerungen oder Wertminderungen von Futures-Kontrakten werden in der Bilanz ausgewiesen. Realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Futures-Kontrakten werden in der Bilanz im Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ ausgewiesen.

(o) Optionskontrakte

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

Bei der Ermittlung des realisierten Gewinns oder Verlusts wird die Prämie für verkaufte Call-Optionen, die ausgeübt wurden, zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung addiert. Die Prämie für verkaufte Put-Optionen, die ausgeübt wurden, wird von den Anschaffungskosten der gekauften Wertpapiere oder Fremdwährungen abgezogen. Erhaltene Prämien für verkaufte Optionen, die ohne Ausübung verfallen, werden als realisierte Gewinne behandelt.

(p) Swap-Instrumente

Swap-Instrumente werden zu ihrem beizulegenden Zeitwert am Tag des Abschlusses des Derivatkontrakts erfasst und anschließend zu ihrem beizulegenden Zeitwert neu bewertet. Die beizulegenden Zeitwerte werden aus festgestellten Marktpreisen auf aktiven Märkten, einschließlich aktueller Markttransaktionen, und mit Bewertungstechniken, einschließlich Discounted-Cashflow-Modellen und Optionspreismodellen, soweit angemessen, ermittelt. Sämtliche Derivate werden als Vermögenswerte ausgewiesen, wenn der beizulegende Zeitwert positiv ist, und als Verbindlichkeiten, wenn der beizulegende Zeitwert negativ ist. Schwankungen des beizulegenden Zeitwerts der Swap-Instrumente sowie der aus den Swap-Instrumenten gezahlten und vereinnahmten Zinsen werden in der Gesamtergebnisrechnung im Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten ausgewiesen.

Credit Default Swaps

Jeder Rentenfonds (wie auf Seite 15 definiert), mit Ausnahme des FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, kann Credit Default Swaps abschließen, vorausgesetzt, dass (i) der Credit Default Swap einer täglichen Bewertung durch die Fonds unterliegt und mindestens wöchentlich unabhängig überprüft wird, und (ii) die mit dem Credit Default Swap verbundenen Risiken halbjährlich unabhängig bewertet werden und der Bericht dem Verwaltungsrat zur Prüfung vorgelegt wird. Ein Fonds kann bei einer Credit Default Swap-Transaktion entweder Käufer oder Verkäufer sein. Der „Käufer“ in einem Credit-Default-Kontrakt ist verpflichtet, an die Gegenpartei während der Laufzeit des Kontrakts regelmäßige Zahlungen zu leisten, sofern kein Ausfall bei einer zugrunde liegenden Referenzverbindlichkeit

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(p) Swap-Instrumente – (Fortsetzung)

eintritt. Wenn ein Fonds ein Käufer ist und kein Zahlungsausfall eintritt, verliert der Fonds seine Anlage und erhält nichts zurück. Wenn der Fonds andererseits ein Käufer ist und ein Ausfallereignis eintritt, erhält der Fonds (der Käufer) den vollen Nominalwert der Referenzverbindlichkeit, die möglicherweise nur einen geringen oder keinen Wert hat. Wenn umgekehrt der Fonds ein Verkäufer ist und ein Ausfallereignis eintritt, muss der Fonds (der Verkäufer) der Gegenpartei im Austausch für die Referenzverbindlichkeit den vollen Nominalwert oder „Nennwert“ der Referenzverbindlichkeit zahlen. Als Verkäufer erhält ein Fonds während der gesamten Laufzeit des Kontrakts, die in der Regel zwischen sechs Monaten und drei Jahren liegt, einen festen Ertragsatz, sofern kein Ausfallereignis eintritt.

Die Fonds erwerben Credit Default Swap-Kontrakte, um sich gegen das Risiko eines Rückgangs des Kapitalpreises oder eines Ausfalls der von ihnen gehaltenen Schuldtitel abzusichern. Die Fonds verkaufen Credit Default Swap-Kontrakte, um am Anstieg des Kapitalpreises zu partizipieren, und das Ausfallrisiko wird vom Käufer von Credit Default Swaps auf den Fonds als Verkäufer des Credit Default Swap-Kontrakts übertragen. Dies birgt das Risiko, dass der Swap wertlos verfällt, und das Kreditrisiko, dass der Verkäufer im Falle eines Zahlungsausfalls seinen Zahlungsverpflichtungen gegenüber den Fonds nicht nachkommt. Die Fonds dürfen solche Geschäfte nur mit Gegenparteien eingehen, die ein Rating von A- oder höher haben.

Zinsswaps

Bei einem Zinsswap oder Cross-Currency-Zinsswap tauscht ein Fonds mit einer anderen Partei jeweils Verpflichtungen zur Zahlung oder zum Erhalt von Zahlungsströmen aus, z. B. ein Tausch von Zahlungen mit variablem Zinssatz gegen Zahlungen mit festem Zinssatz in Basis- oder Fremdwährungen. 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 vorher festgelegten Zinssatz abzuschließen, der über einem bestimmten Referenzzinssatz liegt.

Aktienwaps

Aktienwaps sind Vereinbarungen zwischen einem Fonds und Dritten, die es den Fonds ermöglichen, an der Preisentwicklung bestimmter Wertpapiere zu partizipieren, ohne die Wertpapiere tatsächlich zu kaufen. Veränderungen der Kontraktwerte werden als nicht realisierte Gewinne oder Verluste erfasst und die Fonds verbuchen einen realisierten Gewinn oder Verlust, wenn der Kontrakt glattgestellt 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 Reihe von Cashflows auf der Grundlage der Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswerts zahlt oder erhält, als Gegenleistung für die Zahlung bzw. den Erhalt eines festen oder variablen Zinssatzes auf der Grundlage dieses bestimmten Vermögenswerts. Total Return Swaps werden von einem unabhängigen Preisanbieter zum beizulegenden Zeitwert bewertet. Wenn der Preis nicht verfügbar ist, werden sie vom Franklin Templeton Global Valuation Committee (der „Bewertungsausschuss“) angemessen bewertet. Diese Positionen werden monatlich mit dem Kontrahentenpreis abgeglichen.

Cross-Currency-Swaps

Bei Cross-Currency-Swaps handelt es sich um den Tausch zweier verschiedener Währungen mit der Vereinbarung, den Tausch zu einem späteren Zeitpunkt zu festgelegten Wechselkursen umzukehren. Der Währungstausch zu Beginn des Kontrakts erfolgt zum aktuellen Kassakurs. Der Rücktausch bei Fälligkeit kann zum gleichen Wechselkurs, zu einem festgelegten Kurs oder zum dann aktuellen Kassakurs erfolgen. Gegebenenfalls erfolgen Zinszahlungen zwischen den Parteien auf der Grundlage der bei Beginn des Kontrakts in den beiden Währungen verfügbaren Zinssätze.

Inflationsswaps

Bei Inflationsswaps handelt es sich um den Tausch eines festen Zinssatzes auf einen fiktiven Kapitalbetrag gegen einen variablen Zinssatz, der an einen Inflationsindex gekoppelt ist. 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 an einem bestimmten Datum einen vorher festgelegten Cashflow mit einer Gegenpartei tauscht. Als vereinbarter Tausch für eine Seite dieses Swaps wird ein Renten-, Aktien- oder anderer Preisindex verwendet. Bei einem Overnight-Index-Swap wird ein Overnight-Zinssatz verwendet, beispielsweise die Federal Funds Rate oder die London Interbank Offered Rate (LIBOR). Beim Overnight-Index-Swap handelt es sich um einen Zinsswap, bei dem der Overnight-Satz gegen einen festen Zinssatz getauscht wird.

(q) Differenzkontrakte

Ein Differenzkontrakt ist eine Vereinbarung zwischen zwei Parteien zum Tausch der Differenz zwischen dem Eröffnungspreis und dem Schlusspreis eines Kontrakts. Bei einem Long-Differenzkontrakt verpflichtet sich die Gegenpartei, dem Fonds den etwaigen Betrag zu zahlen, um den der Nominalbetrag des Kontrakts an Wert gewonnen hätte, wenn er in das zugrunde liegende Wertpapier bzw. die zugrunde liegenden Wertpapiere investiert worden wäre, zuzüglich etwaiger Dividenden auf diese Anlagen. Bei einem Short-Differenzkontrakt verpflichtet sich die Gegenpartei, dem Fonds den etwaigen 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 außerdem den Wert aller Dividenden zahlen, die er auf diese Anlagen erhalten hätte.

(r) Wertpapiere, die auf TBA-Basis gehandelt werden

Die Fonds können Wertpapiere auf TAB-Basis („To-be-accoumed“) handeln. Bei einer TBA-Transaktion verpflichtet sich ein Fonds zum Kauf oder Verkauf von Wertpapieren, für die zum Zeitpunkt des Handels noch keine spezifischen Informationen bekannt sind. Auf TBA-Basis erworbene Wertpapiere werden erst abgerechnet, wenn sie an den oder von dem betreffenden Fonds geliefert werden, normalerweise 15 bis 45 Tage später. Diese Transaktionen unterliegen Marktschwankungen und ihr Tageswert wird wie derjenige aller anderen Wertpapiere bestimmt.

(s) Kurzfristige Anlagen

Einlagenzertifikate, Termineinlagen und andere kurzfristige Anlagen, die bei Finanzinstituten gehalten werden, werden zum beizulegenden Zeitwert zu ihrem Nennwert bewertet, gegebenenfalls zuzüglich aufgelaufener Zinsen.

(t) Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

Unter einem Pensionsgeschäft versteht man einen Vertrag, gemäß dem ein Fonds Wertpapiere oder Rechte an einem Titel oder Wertpapier an eine Gegenpartei überträgt und sich verpflichtet, sie zu einem festgelegten Preis an einem festgelegten oder noch festzulegenden Datum in der Zukunft zurückzukaufen. Unter einem umgekehrten Pensionsgeschäft ist ein Vertrag zu verstehen, gemäß dem ein Fonds Wertpapiere oder Rechte an einem Titel oder Wertpapier von einer Gegenpartei mit der Verpflichtung erhält und sich verpflichtet, sie zu einem bestimmten Preis an einem festgelegten oder noch festzulegenden Datum in der Zukunft zurückzukaufen.

Im Rahmen von Pensionsgeschäften erworbene Wertpapiere werden zum beizulegenden Zeitwert zum Nennwert bewertet und um etwaige Wechselkursschwankungen bereinigt. Die Zinssätze sind bei jedem Vertrag anders und werden bei Vertragsbeginn festgelegt. Ihren Richtlinien zufolge nimmt die Gesellschaft die im Rahmen von umgekehrten Pensionsgeschäften erworbenen Wertpapiere in Verwahrung und bewertet sie täglich, um die Gesellschaft für den Fall zu schützen, dass die Wertpapiere nicht von der Gegenpartei zurückgekauft werden. Die Gesellschaft erhält im Allgemeinen zusätzliche Sicherheiten, wenn der Marktwert der zugrunde liegenden Wertpapiere unter dem Nennwert des umgekehrten Pensionsgeschäfts zuzüglich etwaiger aufgelaufener Zinsen liegt. Bei Nichterfüllung der Rückkaufverpflichtung hat die Gesellschaft das Recht, die Sicherheiten zu verwerten und den Erlös für die Erfüllung der Verpflichtung zu verwenden. Im Falle eines Zahlungsausfalls oder einer Insolvenz der Gegenpartei muss die Verwertung und/oder Einbehaltung der Sicherheiten oder Erlöse unter Umständen gerichtlich geklärt werden. Zur effizienten Portfolioverwaltung wurden im Geschäftsjahr umgekehrte Pensionsgeschäfte eingesetzt.

(u) Börsengehandelte Fonds

Die Fonds können in börsengehandelte Fonds („ETFs“) investieren. ETFs sind Wertpapiere, die einen Index oder einen Wertpapierkorb wie bei einem Indexfonds abbilden, jedoch wie eine Aktie an der Börse gehandelt werden. These securities are subject to market fluctuations and their current value is determined in the same manner as for other securities.

(v) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen

Der beizulegende Zeitwert von Anlagen in offene Investmentfonds basiert auf dem ungeprüften Nettoinventarwert pro Anteil, wie von der Verwaltungsstelle des jeweiligen Fonds bereitgestellt.

(w) Swaptions

Bestimmte Fonds können zur Absicherung gegen ungünstige Zinsentwicklungen in Swaptions investieren. Solche Instrumente vereinen die Merkmale zweier anderer Finanzinstrumente, nämlich einer Option und eines Zinsswaps. Die Fonds verbuchen einen nicht realisierten Gewinn/Verlust (beizulegender Zeitwert) für den Betrag, der voraussichtlich im Rahmen der Vereinbarung vereinnahmt oder gezahlt wird, wenn dieser Betrag bei der Bewertung terminiert wurde. Der beizulegende Zeitwert wird täglich von Markt als Datenanbieter bereitgestellt. Der nicht realisierte Gewinn/Verlust wird in der Bilanz als finanzieller Vermögenswert oder finanzielle Verbindlichkeit ausgewiesen.

(x) Treasury Inflationary Index Obligations (TIPS)

Bestimmte Fonds können in indexgebundene Wertpapiere investieren. Indexgebundene Wertpapiere sind Wertpapiere, deren Preise an die Preise von Wertpapierindizes, Währungen oder andere Finanzstatistiken gekoppelt sind. Indexgebundene Wertpapiere sind in der Regel Schuldtitel oder Einlagen, deren Wert bei Fälligkeit und/oder Kuponsatz durch Bezugnahme auf ein bestimmtes Instrument oder eine bestimmte Statistik bestimmt wird. Die Wertentwicklung indexgebundener Wertpapiere schwankt (je nach Instrument entweder direkt oder umgekehrt) mit der Wertentwicklung des Index, Wertpapiers oder der Währung. Die Wertpapiere werden täglich vom jeweiligen Datenanbieter zum beizulegenden Zeitwert bewertet und die Änderung des beizulegenden Zeitwerts wird von den Fonds als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst.

(y) Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen

Bei Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen handelt es sich um fest- und variabel verzinsliche Darlehen, die durch private Verhandlungen zwischen einem Unternehmen oder einem anderen Rechtsträger und einem oder mehreren Finanzinstituten vereinbart werden. Solche Anlagen werden voraussichtlich in Form von Beteiligungen an den Darlehen oder Abtretungen getätigt, die verbrieft sein können oder nicht. Schuldscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen werden von der Gesellschaft als erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte klassifiziert und anfangs 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.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsmethoden – (Fortsetzung)

(z) Master-Limited Partnership

Bestimmte Fonds können in Master-Limited Partnerships (MLPs) investieren, indem sie an Kommanditisten der MLP ausgegebene Anteile kaufen, die öffentlich auf geregelten Märkten gehandelt werden. MLPs sind Kommanditgesellschaften oder Gesellschaften mit beschränkter Haftung, die in der Regel Einnahmen und Gewinne aus der Exploration, Erschließung, Lagerung, Sammlung, Förderung, Produktion, Verarbeitung, Raffination, dem Transport (einschließlich Pipelines zum Transport von Gas, Öl oder davon abgeleiteten Produkten) oder der Vermarktung von Mineralien oder natürliche Ressourcen erzielen. MLPs haben im Allgemeinen zwei Kategorien von Eigentümern: den Komplementär und die Kommanditisten. Kommanditisten besitzen den übrigen Teil der Partnership durch den Besitz von Stammanteilen und spielen eine begrenzte Rolle im Betrieb und Management.

Der beizulegende Zeitwert einer Anlage in MLPs wird auf die gleiche Weise ermittelt wie bei anderen Wertpapieren. Die Änderungen des beizulegenden Zeitwerts werden als nicht realisierter Gewinn oder Verlust erfasst.

(aa) Zinserträge und Zinsaufwendungen

Zinserträge und Zinsaufwendungen umfassen Zinserträge und Zinsaufwendungen für Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente, Termineinlagen und Margin-Bargeld. Zinserträge und Zinsaufwendungen werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

(ab) Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung

Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Futures-Kontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden.

Für offene börsengehandelte und außerbörslich gehandelte Derivatkontrakte werden Margin-Einlagen bei Brokern gehalten bzw. an Broker verpfändet. Von den Fonds für den Derivatehandel bereitgestellte oder erhaltene Barsicherheiten werden ebenfalls in der Bilanz im Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ ausgewiesen und sind nicht als Bestandteile des Postens Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente erfasst. Barsicherheiten sind Beträge im Zusammenhang mit dem Derivatehandel und werden am Jahresende bei Brokern gehalten. Im Zusammenhang mit dem Derivatehandel erhaltene Barsicherheiten werden bei The Bank of New York Mellon SA/NV, Dublin Branch, und etwaigen Unterdepotbanken verwahrt und sind am Jahresende an Broker zahlbar.

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

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

(ad) Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile

Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile werden am Ex-Dividende-Datum erfasst und als „Finanzierungskosten“ in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.

3. Effiziente Portfolioverwaltung

Vorbehaltlich der Bedingungen und innerhalb der Grenzen, die gelegentlich von der Central Bank of Ireland (die „Zentralbank“) festgelegt werden, und sofern die Anlageziele und Anlagepolitik eines Fonds keine abweichende Regelung vorsehen, können die Anlagemanager und/oder Untermanager Investmentmethoden und -instrumente wie Futures, Optionen, Devisenterminkontrakte und sonstige Derivate für die Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung verwenden. Außerdem werden eventuell neue Methoden und Instrumente entwickelt, die künftig für einen Fonds geeignet sein können, und ein Fonds kann diese Methoden und Instrumente einsetzen, wenn dies vorher genehmigt wurde und alle Beschränkungen der Zentralbank eingehalten werden.

Für OGAW, die Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung angewendet haben, sind gemäß den OGAW-Bestimmungen der Zentralbank Offenlegungen erforderlich. Ein OGAW ist verpflichtet, die Erträge aus Techniken zur effizienten Portfolioverwaltung für das gesamte Berichtsjahr zusammen mit den direkten und indirekten Betriebskosten und den angefallenen Gebühren auszuweisen. Siehe dazu die nachstehenden Tabellen.

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 Berichtsjahres wurden umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung abgeschlossen. Details zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Berichtszeitraums sind im Anlagenportfolio aufgeführt.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Teil des Vermögens jedes Fonds kann in anderen liquiden Mitteln gehalten werden. Für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen.

Die nachstehende Tabelle enthält die in den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2023 und zum 28. Februar 2022 mit umgekehrten Pensionsgeschäften erzielten Erträge:

Name des Fonds	28. Februar 2023 (in Tsd.)	28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	5,725\$	70\$

Es wurden keine Transaktionskosten für die Käufe und Verkäufe von umgekehrten Pensionsgeschäften erhoben.

Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können für die Zwecke einer effizienten Portfolioverwaltung wie oben dargelegt auch Wertpapierleihgeschäfte abschließen. Im Rahmen solcher Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei sich der Entleiher verpflichtet, zu einem vorab vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere an den Fonds zurückzugeben. Beim Abschluss solcher Transaktionen wird sich der Fonds bemühen, die Renditen auf sein Wertpapierportfolio zu erhöhen, indem er für die Bereitstellung seiner Wertpapiere für den Entleiher eine Gebühr erhebt. Keiner der Fonds hat in den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2023 und zum 28. Februar 2022 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 die einzelnen Anteilsklassen (als Prozentsatz des jeweiligen Nettoinventarwerts des Fonds, der auf diese Klasse entfällt) stellt sich wie folgt dar:

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

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]	
Klasse A	1,000 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,250 %	Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,500 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	1,600 %	Klasse E	2,100 %
Klasse F	0,550 %	Klasse F	0,800 %
Klasse R	0,600 %	Klasse R	1,100 %
Klasse T	1,000 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,300 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,300 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,450 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse LM	keine
Klasse B (G)	1,650 %		
Klasse L (G)	1,650 %	FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		Klasse A	0,950 %
Klasse A	0,800 %	Klasse B	1,250 %
Klasse B	1,050 %	Klasse C	1,450 %
Klasse C	1,300 %	Klasse E	1,550 %
Klasse E	1,400 %	Klasse F	0,700 %
Klasse F	0,550 %	Klasse R	0,850 %
Klasse R	0,400 %	Klasse T	0,950 %
Klasse T	0,800 %	Klasse X	0,450 %
Klasse X	0,300 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse S	0,300 %
Klasse S	0,200 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse L (G)	1,750 %
Klasse GE	1,420 %	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]	
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]		Klasse A	0,900 %
Klasse A	0,950 %	Klasse B	1,150 %
Klasse B	1,200 %	Klasse C	1,400 %
Klasse C	1,450 %	Klasse E	1,500 %
Klasse E	1,550 %	Klasse F	0,600 %
Klasse F	0,700 %	Klasse R	0,550 %
Klasse R	0,550 %	Klasse T	0,900 %
Klasse X	0,450 %	Klasse X	0,450 %
Premier-Klasse	0,450 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse S	0,300 %	Klasse S	0,250 %
Klasse S	keine	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	Klasse A (G)	1,100 %
Klasse A (G)	1,200 %	Klasse L (G)	1,600 %
Klasse B (G)	1,700 %	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
Klasse L (G)	1,700 %	Klasse A	1,100 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		Klasse B	1,350 %
Klasse A	1,100 %	Klasse C	1,600 %
Klasse B	1,350 %	Klasse E	1,700 %
Klasse C	1,600 %	Klasse F	0,850 %
Klasse E	1,700 %	Klasse R	0,700 %
Klasse F	0,650 %	Klasse T	1,100 %
Klasse R	0,700 %	Klasse X	0,600 %
Klasse T	1,100 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse X	0,550 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	0,400 %	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	
Klasse LM	keine	Klasse A	0,850 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund		Klasse B	1,100 %
Klasse A	0,950 %	Klasse C	1,350 %
Klasse B	1,200 %	Klasse E	1,450 %
Klasse C	1,450 %	Klasse F	0,600 %
Klasse E	1,550 %	Klasse R	0,450 %
Klasse F	0,700 %	Klasse T	0,850 %
Klasse R	0,550 %	Klasse X	0,350 %
Klasse T	0,950 %	Premier-Klasse	0,350 %
Klasse X	0,450 %	Klasse S	0,250 %
Premier-Klasse	0,450 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,300 %	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]	
Klasse S	keine	Klasse A	0,900 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,150 %
Klasse A (G)	1,150 %	Klasse C	1,400 %
Klasse L (G)	1,650 %	Klasse E	1,500 %
Klasse GF	0,950 %	Klasse F	0,650 %
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]		Klasse R	0,500 %
Klasse A	1,500 %	Klasse T	0,900 %
Klasse B	1,750 %	Klasse X	0,400 %
Klasse C	2,000 %	Premier-Klasse	0,400 %
Klasse E	2,100 %	Klasse S	0,300 %
Klasse F	0,800 %	Klasse LM	keine
Klasse R	1,100 %	FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]	
Klasse T	1,500 %	Klasse A	0,850 %
Klasse X	0,750 %	Klasse B	1,100 %
Premier-Klasse	0,550 %	Klasse C	1,350 %
Klasse S	0,450 %	Klasse E	1,450 %
Klasse LM	keine	Klasse F	0,600 %
Klasse A (G)	1,250 %	Klasse R	0,650 %
Klasse B (G)	1,750 %	Klasse T	0,850 %
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse X	0,350 %
		Premier-Klasse	0,350 %
		Klasse S	0,250 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A	1,150 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,400 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,650 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,750 %	Klasse E	1,700 %
Klasse F	0,700 %	Klasse F	0,850 %
Klasse R	0,750 %	Klasse R	0,700 %
Klasse T	1,150 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,575 %	Klasse X	0,600 %
Premier-Klasse	0,450 %	Premier-Klasse	0,600 %
Klasse S	0,350 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		Klasse A	1,350 %
Klasse A	1,500 %	Klasse B	1,600 %
Klasse B	1,750 %	Klasse C	1,850 %
Klasse C	2,000 %	Klasse E	1,950 %
Klasse E	2,100 %	Klasse F	1,100 %
Klasse F	1,250 %	Klasse J	0,900 %
Klasse R	1,100 %	Klasse R	0,950 %
Klasse T	1,500 %	Klasse X	0,900 %
Klasse X	1,000 %	Premier-Klasse	0,900 %
Klasse Y	1,000 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	1,000 %	FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Klasse S	0,600 %	Klasse A	1,100 %
Klasse LM	keine	Klasse F	0,750 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		Klasse T	1,100 %
Klasse A	1,250 %	Klasse X	0,550 %
Klasse B	1,500 %	Premier-Klasse	0,550 %
Klasse C	1,750 %	Klasse S	0,450 %
Klasse E	1,850 %	Klasse LM	keine
Klasse F	0,800 %	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	
Klasse R	0,750 %	Klasse A	1,150 %
Klasse T	1,250 %	Klasse B	1,400 %
Klasse X	0,625 %	Klasse C	1,650 %
Premier-Klasse	0,600 %	Klasse E	1,750 %
Klasse S	0,400 %	Klasse F	0,900 %
Klasse LM	keine	Klasse R	0,750 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		Klasse T	1,150 %
Klasse D	1,200 %	Klasse X	0,650 %
Klasse F	1,200 %	Premier-Klasse	0,650 %
Klasse M	0,600 %	Klasse LM	keine
Premier-Klasse	0,600 %	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	
Klasse LM	keine	Klasse A	1,100 %
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		Klasse B	1,350 %
Klasse A	1,000 %	Klasse C	1,600 %
Klasse B	1,250 %	Klasse E	1,700 %
Klasse C	1,500 %	Klasse F	0,800 %
Klasse E	1,600 %	Klasse J	0,450 %
Klasse F	0,550 %	Klasse R	0,700 %
Klasse R	0,600 %	Klasse T	1,100 %
Klasse X	0,500 %	Klasse X	0,450 %
Premier-Klasse	0,300 %	Premier-Klasse	0,450 %
Klasse LM	keine	Klasse S	0,350 %
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		Klasse LM	keine
Klasse A	0,800 %	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]	
Klasse R	0,500 %	Klasse A	1,650 %
Klasse T	0,800 %	Klasse B	1,900 %
Klasse X	0,400 %	Klasse C	2,150 %
Premier-Klasse	0,300 %	Klasse E	2,250 %
Klasse S	0,200 %	Klasse F	1,300 %
Klasse LM	keine	Klasse J	0,750 %
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		Klasse R	1,250 %
Klasse A	0,800 %	Klasse T	1,650 %
Klasse F	0,550 %	Klasse X	1,150 %
Klasse R	0,500 %	Premier-Klasse	1,150 %
Klasse T	0,800 %	Klasse S	0,750 %
Klasse X	0,300 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,300 %	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]	
Klasse S	0,200 %	Klasse A	1,050 %
Klasse LM	keine	Klasse B	1,300 %
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		Klasse C	1,550 %
Klasse LM	keine	Klasse E	1,650 %
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		Klasse F	0,700 %
Klasse A	0,850 %	Klasse T	1,050 %
Klasse B	1,100 %	Klasse X	0,525 %
Klasse C	1,350 %	Premier-Klasse	0,525 %
Klasse E	1,450 %	Klasse S	0,400 %
Klasse F	0,600 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,650 %	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]	
Klasse T	0,850 %	Klasse A	2,000 %
Klasse X	0,350 %	Klasse T	2,000 %
Premier-Klasse	0,350 %	Klasse U	1,000 %
Klasse S	0,250 %	Klasse X	1,150 %
Klasse LM	keine	Premier-Klasse	1,150 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr	Fondsname	Maximale Verwaltungsgebühr
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %	Klasse M	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %	Klasse T	1,500 %
Premier-Klasse	0,750 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Klasse A (G)	1,250 %	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]	
Klasse L (G)	1,750 %	Klasse A	1,500 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,500 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	2,000 %	Klasse E	2,250 %
Klasse C	2,000 %	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 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse X	0,750 %	Klasse S	0,650 %
Premier-Klasse	0,750 %	Klasse LM	keine
Klasse S	0,550 %	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	
Klasse LM	keine	Klasse A	1,500 %
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]		Klasse B	2,000 %
Klasse A	1,350 %	Klasse C	2,000 %
Klasse B	1,850 %	Klasse D	1,100 %
Klasse C	1,850 %	Klasse E	2,250 %
Klasse E	2,100 %	Klasse F	1,250 %
Klasse F	1,100 %	Klasse R	1,000 %
Klasse R	0,850 %	Klasse T	1,500 %
Klasse T	1,350 %	Klasse X	0,750 %
Klasse X	0,675 %	Premier-Klasse	0,750 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse S	0,440 %
Klasse S	0,500 %	Klasse LM	keine
Klasse LM	keine	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]	
Klasse A (G)	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B (G)	1,850 %	Klasse B	2,000 %
Klasse L (G)	1,850 %	Klasse C	2,000 %
Klasse GA	1,420 %	Klasse E	2,250 %
Klasse GE	2,170 %	Klasse F	1,250 %
Klasse GP	0,850 %	Klasse J	0,650 %
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		Klasse R	1,000 %
Klasse A	1,350 %	Klasse T	1,500 %
Klasse B	1,850 %	Klasse X	0,750 %
Klasse C	1,850 %	Premier-Klasse	0,750 %
Klasse E	2,100 %	Klasse S	0,650 %
Klasse F	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,850 %	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]	
Klasse T	1,350 %	Klasse A	1,500 %
Klasse X	0,675 %	Klasse B	2,000 %
Premier-Klasse	0,675 %	Klasse C	2,000 %
Klasse S	0,500 %	Klasse E	2,250 %
Klasse LM	keine	Klasse F	1,250 %
Klasse GA	1,620 %	Klasse R	1,000 %
Klasse GE	2,370 %	Klasse X	0,750 %
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]		Premier-Klasse	0,750 %
Klasse A	1,350 %	Klasse S	0,650 %
Klasse B	1,850 %	Klasse LM	keine
Klasse C	1,850 %	Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse E	2,100 %	Klasse A	0,60 %
Klasse F	1,100 %	Klasse D	1,15 %
Klasse R	0,850 %	Klasse K	0,60 %
Klasse T	1,350 %	Klasse X	0,20 %
Klasse X	0,675 %		
Premier-Klasse	0,675 %		
Klasse S	0,500 %		
Klasse LM	keine		
Klasse GA	1,420 %		
Klasse GE	2,170 %		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Die in den obenstehenden Tabellen angegebenen Verwaltungsgebühren für die einzelnen Fonds gelten für alle in der jeweiligen Spalte aufgeführten Anteilsklassen, die der Fonds anbietet. Es werden nicht alle Anteilsklassen von jedem Fonds angeboten und zum Ende des aktuellen und vorhergehenden 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 2023 und 28. Februar 2022 endenden Geschäftsjahre hat die Verwaltungsgesellschaft folgende Gebühren erlassen bzw. erstattet:

Name des Fonds	28. Februar 2023 (in Tsd.)		28. Februar 2022 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebühr	Verwaltungsgebühr, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden	Erlassene Verwaltungsgebühr	Verwaltungsgebühr, die erstattet wird, und sonstige Ausgaben, die wiederhergestellt werden
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	622\$	23\$	4.389\$	647\$
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	9\$	\$-	\$-	\$-
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	3\$	\$-	\$-	\$-
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	3\$	\$-	1\$	\$-
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	\$-	1\$	\$-	\$-
FTGF Western Asset US High Yield Fund	2\$	2\$	\$-	\$-
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	\$-	10\$	1\$	\$-
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	\$-	17\$	\$-	\$-
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	14\$	13\$	\$-	\$-
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	\$-	\$-	1\$	\$-
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	\$-	\$-	\$-	2\$
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	€-	11€	€-	€-
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1\$	\$-	1\$	\$-
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	\$-	76\$	\$-	85\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	28\$	22\$	4\$	23\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	35\$	\$-	34\$	\$-
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	22\$	3\$	6\$	2\$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	32\$	33\$	36\$	1\$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	\$-	24\$	\$-	20\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	17\$	15\$	\$-	\$-
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	10\$	47\$	9\$	31\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	19\$	\$-	10\$	\$-
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	25\$	\$-	21\$	\$-
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	14\$	24\$	11\$	2\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	\$-	\$-	3\$	\$-
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	26\$	2\$	9\$	14\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€	7€	€-	€-
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	1\$	\$-	1\$	\$-
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	\$-	\$-	\$-	23\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	\$-	33\$	4\$	\$-
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	35\$	\$-	3\$	\$-
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	€-	€-	5€	13€
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	2\$	7\$	1\$	5\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	36\$	\$-	9\$	\$-
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	6€	5€	3€	€-
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	6€	14€	€-	€-

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

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

Gemäß den Bestimmungen des Hauptvertriebsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors, LLC (der „Master-Distributor“), ist der Master-Distributor ermächtigt, Anteile der Gesellschaft zu vermarkten, zu bewerben, anzubieten und deren Verkauf und Rücknahme zu arrangieren (zusammen als „Vertriebsleistungen“ bezeichnet). Zudem ist der Master-Distributor berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen einen oder mehrere Vertriebshändler zu beauftragen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, sofern die Ernennungen solcher Firmen gemäß den Anforderungen der Regeln der Zentralbank erfolgen. Gemäß den Bestimmungen des Rahmenanlageverwaltungsvertrags zwischen dem Anlage-Manager und dem Master-Distributor, haftet der Master-Distributor in solchen Fällen gegenüber dem Verwalter für die Erfüllung seiner Aufgaben gemäß dem betreffenden Vertrag. Der Master-Distributor hat gemäß den Anforderungen der Zentralbank Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited („LMAMHK“) (eingestellt am 1. Juli 2022), Franklin Templeton Investments (Asia) Limited („FTIA“) (mit Wirkung vom 1. Juli 2022) und Templeton Asset Management Ltd. (mit Wirkung vom 1. Januar 2023, vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) als zusätzliche Vertriebs- und Dienstleistungsstellen der Fonds beauftragt. Der Manager hat sich selbst und Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung bestimmter Vertriebsdienstleistungen beauftragt.

Die Gesellschaft ist ferner für die umgehende Zahlung bzw. Rückerstattung von Geldern an die Verwaltungsgesellschaft verantwortlich, die diese als Provisionen, Übertragungsgebühren, Registrierungsgebühren, Steuern und ähnliche Verbindlichkeiten sowie Kosten und Spesen zu zahlen hat bzw. ihr entstanden sind.

Informationsstellengebühr

Gemäß dem Verwaltungsvertrag zwischen der Gesellschaft und dem Verwalter steht dem Verwalter eine Informationsstellengebühr aus dem Vermögen des jeweiligen Fonds für seine Dienstleistungen zu, die an jedem Handelstag aufläuft und jeden Monat rückwirkend gezahlt wird (die „Informationsstellengebühr“). Die Informationsstellengebühren laufen an jedem Handelstag auf und werden rückwirkend monatlich gezahlt. Im Rahmen des Master-Informationsstellenvertrags zwischen dem Manager, der Gesellschaft und Franklin Distributors hat LLC (der „Hauptanteilsignervertreter“), der Hauptanteilsvertreter für seine Dienste Anspruch auf den Erhalt einer vom Verwalter aus bestimmten Anteilsklassen zu zahlenden Dienstleistungsgebühr.

Gemäß den Bestimmungen des Hauptinformationsstellenvertrags ist der Hauptanteilsignervertreter berechtigt, auf eigene Kosten und Aufwendungen eine oder mehrere Parteien zu bestellen, die sie bei der Erfüllung ihrer Pflichten aus dem Vertrag unterstützen sollen, wobei der Hauptanteilsignervertreter der Gesellschaft gegenüber weiterhin für die Erfüllung ihrer Verpflichtungen aus diesem Vertrag haftet. Dementsprechend hat der Master Shareholder Servicing Agent LMAMHK (eingestellt am 1. Juli 2022), FTIA (mit Wirkung vom 1. Juli 2022) und Templeton Asset Management Ltd. (mit Wirkung vom 1. Januar 2023, vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) als zusätzliche Vertriebs- und Dienstleistungsstellen der Gesellschaft beauftragt. Der Manager hat Franklin Templeton Securities Investment Consulting (SinoAm) Inc. mit der Erbringung von Aktionärsdienstleistungen in Bezug auf Taiwan beauftragt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Der Gesamtbetrag der von jeder Aktienklasse gezahlten Informationsstellengebühren entspricht oder hat folgendem entsprochen:

- (i) 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, 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[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Global Inflation Management 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[^], Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] und
- (ii) 0,35 % p.a. des Nettoinventarwerts des FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

Die Informationsstellengebühren müssen für alle Anteilsklassen bezahlt werden, außer für die Anteilsklassen der Klasse F, der Klasse J, der Klasse U, der Klasse Y, der Premier-Anteilsklassen, der LM-Anteilsklassen, der Grandfathered-Anteilsklassen und der Galleon-Anteilsklassen (jeweils wie im Prospekt definiert). Ebenfalls nicht bezahlt werden müssen sie für alle Anteilsklassen, die vom FTGF Mason Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^] und Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] angeboten werden.

In den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 wurde auf folgende Informationsstellengebühren verzichtet:

Fondsname	Erlassene	Erlassene
	Informationsstellengebühren	Informationsstellengebühren
	28. Februar 2023	28. Februar 2022
	(in Tsd.)	(in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	42\$	\$-
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	12\$	\$-
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	21\$	10\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	6\$	\$-
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	4\$	7\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	21\$	\$-
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	5\$	1\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	1\$	\$-
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	8\$	3\$
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	1\$	\$-
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	15\$	\$-
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	21\$	10\$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	89\$	97\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	1\$	1\$
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	2\$	3\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	\$-	5\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	11\$	\$-
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	1€	3€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	30\$	15\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	\$-	10\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	8\$	116\$
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	€-	11€
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	31\$	19\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	5\$	2\$

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 2023 beliefen sich diese Aufwendungen auf 1.313.151 \$ (28. Februar 2022: 1.260.797 \$).

Verbundene Parteien

Jane Trust, Jaspal Sagger und William Jackson sind Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft und sind auch Verwaltungsratsmitglieder und/oder Führungskräfte bestimmter verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter, der Vertriebs- und Informationsstellen. Joseph Carrier war Verwaltungsratsmitglied der Gesellschaft und bis zum Ende seiner Beschäftigung bei Franklin Templeton Investments am 3. Oktober 2022 auch Verwaltungsratsmitglied und/oder leitender Angestellter einiger verbundener Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter, der Vertriebsstellen und der Informationsstellen. William Jackson und Jane Trust sind ebenfalls Direktoren von FTIS. Die übrigen Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft, wie oben aufgeführt, sind oder waren alle entweder Mitarbeiter von FTIS oder einer ihrer Tochtergesellschaften. 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 2023 und zum 28. Februar 2022 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die denselben Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie die Fonds oder eine verbundene Partei dieses Anlageverwalters oder Unteranlageverwalters bestellt haben.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	28. Februar 2023		28. Februar 2022	
		%	Wert (in Tsd.)	%	Wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.741\$	0,30 %	5.470\$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	654 €	0,05 %	808 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	12,62 %	1.117\$	11,55 %	6.832\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	21,75 %	2.899\$	11,08 %	4.821\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.661\$	0,05 %	914\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	1,50 %	133\$	1,29 %	762\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,17 %	3.862\$	0,68 %	12.311\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,73 %	17.040\$	0,37 %	6.636\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	3,14 %	10.921\$	2,52 %	20.460\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD thesaurierend	2,22 %	296\$	–	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	559\$	0,04 %	718\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	24,65 %	2.181\$	24,56 %	14.535\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,70 %	16.369\$	–	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	5,73 %	507\$	4,81 %	2.845\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,74 %	17.212\$	2,00 %	36.257\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	1.154\$	1,03 %	18.650\$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,06 %	1.342\$	0,01 %	213\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	30\$	0,00 %	64\$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,39 %	32.545\$	2,31 %	41.913\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,05 %	1.100\$	0,08 %	1.480\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	180\$	0,01 %	140\$

Die Kapitalanlagen werden in den Finanzabschlüssen in Erläuterung 13 über die Fondsgeschäfte hinweg ausgewiesen.

Transaktionskosten

Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Aktien, Organismen für gemeinsame Anlagen, Futures-Kontrakten und Optionen für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	28. Februar 2023 (in Tsd.)	28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	32\$	43\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	248\$	235\$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	10€	11€
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	9\$	12\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	\$–	1\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Western Asset US High Yield Fund	6\$	4\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	1\$	2\$
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	\$–	3\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	5\$	16\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	14\$	16\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	14\$	22\$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	3\$	3\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	9.768\$	7.891\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	32\$	83\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	23\$	29\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	51\$	36\$
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	1£	2£
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	7\$	7\$
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	11\$	7\$
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	2\$	7\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	90\$	23\$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	\$–	4\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	41\$	81\$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	16\$	8\$
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	4\$	14\$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	1\$	1\$
FTGF ClearBridge Value Fund	260\$	247\$
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	4\$	6\$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	57\$	58\$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	36\$	64\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	3\$	5\$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Name des Fonds	28. Februar 2023 (in Tsd.)	28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	81\$	161\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	7\$	9\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	1.247€	546€
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	\$–	3\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	904\$	355\$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	1.128\$	2.082\$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	91\$	92\$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	5\$	7\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	€–	24€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	11\$	26\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	\$–	3\$
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	32\$	144\$
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	181\$	215\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	13\$	13\$
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	40\$	45\$
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	153€	467€

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

Performancegebühr

Zusätzlich zu den oben beschriebenen Anlageverwaltungsgebühren war der Anlageverwalter berechtigt, in Abhängigkeit von der Wertentwicklung der Anteile der Anteilsklasse PF eine erfolgsabhängige Gebühr („Performancegebühr“) zu erheben (Performancegebührenklassen enthalten ein „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse).

Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (stellte den Handel am 1. Juni 2021 ein)

Beim Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] wird die Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in der Regel (oder wurde in der Regel) in Bezug auf jeden zwölfmonatigen Zeitraum, der am letzten Handelstag jedes Geschäftsjahres endet, berechnet („Berechnungszeitraum“). Für jede Anteilsklasse PF war der erste Berechnungszeitraum der Zeitraum, der an dem Geschäftstag beginnt, der unmittelbar auf den Börsentag folgt, an dem der Nettoinventarwert für die Anteilsklasse erstmals berechnet wurde (der „Erste Handelstag“), und der am letzten Handelstag des Geschäftsjahres endet, in dem der erste Handelstag eintritt (der „Erste Berechnungszeitraum“).

Für jeden Berechnungszeitraum hat der Anlageverwalter für jeden Anteil der Anteilsklasse PF ggf. Anspruch auf eine Performancegebühr in Höhe von 20 % des Betrags, um den die Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während dieses Zeitraums die High Water Mark (wie nachfolgend definiert) zum Ende des vorausgehenden Berechnungszeitraums übersteigt. Bei ausschüttenden Anteilsklassen wurden alle während des jeweiligen Zeitraums ausgezahlten Ausschüttungen zwecks Ermittlung der Entwicklung des Nettoinventarwerts je Anteil während eines Berechnungszeitraums dem Nettoinventarwert zugerechnet. Für alle Anteilsklassen PF gilt, dass die für einen Berechnungszeitraum fällige Performancegebühr nicht von Verlusten berührt war, die die Fonds oder die Anteilsklasse PF in späteren Berechnungszeiträumen erleiden. Die Performancegebühr fiel an jedem Handelstag an und wurde normalerweise innerhalb von 21 Tagen nach dem Ende des jeweiligen Berechnungszeitraums nach Prüfung durch die Depotbank gezahlt. Wenn der Anlageverwaltungsvertrag vor dem letzten Handelstag eines Geschäftsjahres endet, wird bei der Berechnung und Zahlung der Performancegebühr für jede Anteilsklasse PF in Bezug auf den laufenden Berechnungszeitraum davon ausgegangen, dass das Datum des Vertragsendes das Ende des Berechnungszeitraums ist. Sofern ein Anteilsinhaber seine Anteile der Anteilsklasse PF vor dem Ende eines Berechnungszeitraums einlöst, wird die aufgelaufene und diesen Anteilen zurechenbare Performancegebühr herauskristallisiert und dem Anlageverwalter nach Abzug der fälligen Performancegebühr von den Rücknahmeerlösen gezahlt.

Die High Water Mark in Bezug auf jede PF-Anteilsklasse des Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] bedeutete den höheren der folgenden Werte: (i) dem anfänglichen Angebotspreis pro Anteil; (ii) dem höchsten Nettoinventarwert pro Anteil, der unmittelbar nach dem Ende eines früheren Berechnungszeitraums galt; und (iii) falls die PF-Anteilsklasse durch eine Verschmelzung einer Anteilsklasse eines anderen vom Unteranlageverwalter verwalteten Fonds aufgeleitet wurde, die Hochwassermark für diese Anteilsklasse am Tag der Verschmelzung, wie sie gemäß dem entsprechenden Angebotsdokument für diesen anderen Fonds berechnet wird.

Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] führte keine Ausgleichskonten für Anteilsinhaber in Bezug auf die aufgelaufenen Performancegebühren.

Im Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 wurden keine Erfolgsprämien berechnet (28. Februar 2022: Berechnete Erfolgsprämien werden in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen.).

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

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

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf den Berichtszeitraum zum 28. Februar 2023 beziehenden erfolgswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 143.000 \$ (28. Februar 2022: 140.000 \$).

Verwaltungsrats Honorare sind nicht zahlbar für Jane Trust, Jaspal Sagger und William Jackson, die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind. Verwaltungsrats Honorare waren nicht zahlbar für Joseph Carrier bis zum 3. Oktober 2022, dem Datum der Beendigung seiner Vollzeitbeschäftigung bei Franklin Templeton Investments. Herr Carrier wird weiterhin als nicht geschäftsführendes Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft tätig sein und ab dem 3. Oktober 2022 genauso vergütet werden wie die übrigen nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft.

Prüfungshonorar

Die an den Abschlussprüfer PricewaterhouseCoopers für das Geschäftsjahr gezahlten Honorare in Höhe von 1.064.363 € (ohne MwSt.) beziehen sich auf die gesetzlich vorgeschriebene Prüfung des Abschlusses der Gesellschaft (28. Februar 2022: 1.068.650 € (ohne MwSt.)). Das gesamte Prüfungshonorar für die Gesellschaft, wie in der Gesamtergebnisrechnung auf Seite 226 aufgeführt, versteht sich inklusive Mehrwertsteuer von 23 % und ist in der Darstellungswährung der Gesellschaft (US-Dollar) angegeben.

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 beliefen sich die an den Abschlussprüfer gezahlten Auslagen auf 11.804 € (für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 wurden keine Auslagen an den Abschlussprüfer gezahlt).

Andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

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 2023	Beteiligung in % 28. Februar 2022
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	71,16	73,47
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	21,10	–
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	–	26,73
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	92,89	97,13
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	–	22,36
FTGF Western Asset US High Yield Fund	34,32	25,50
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	–	66,96
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	–	24,70
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	–	22,32
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	29,86	31,62
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	21,21	–
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	–	73,89
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	29,89	39,26
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	26,15	32,01
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	68,41	61,17
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	77,47	84,13
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	44,11
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	24,98
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	–	21,74
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	35,78	32,51
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	68,68	39,07
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	94,78	99,94

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fonds	Beteiligung in % 28. Februar 2023	Beteiligung in % 28. Februar 2022
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	100,00	100,00
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	81,03	83,85
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	95,79	94,78
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	65,31	65,44
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	23,18	23,00
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	32,53	72,28
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	23,04	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	96,36	96,77
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	51,35	50,15
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	21,00	20,52
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	31,26	44,84
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	27,49	24,50
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	40,60	39,63
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	26,66	24,02
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	99,01	99,02
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	91,03	79,63
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	–	20,36
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	100,00	–
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	–	94,31
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	75,02	–
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	32,03	32,50
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	45,87	28,47
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	–	20,79
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	34,53	37,18
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	54,38	48,76
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	–	23,67
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	21,50	–
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	–	97,91
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	27,65	75,35
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	21,57	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	40,84	38,93
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	99,79	100,00
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	–	54,02
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	41,38	38,44
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	22,30	50,58
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	21,52	–
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	60,68	35,12
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	58,97	59,03
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	23,93	21,24
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	27,69	36,19
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	26,36	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	26,85	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	20,92	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	53,20	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	24,34	–

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

5. Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile

Ausschüttende Anteilsklassen

Der hinter dem Namen jeder ausschüttenden Anteilsklasse in Klammern angegebene Buchstabe gibt an, in welchen Abständen die in der nachfolgenden Tabelle aufgeführten Dividenden erklärt und gezahlt werden.

Bezeichnung der ausschüttenden Anteilsklasse	Häufigkeit der Dividendenerklärungen	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: (1) Etwaige Nettoerträge 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, wobei dies nicht zwingend ist.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Mischfonds (wie auf Seite 15 definiert) wird zum Zeitpunkt der Dividendenerklärung der gesamte oder ein Teil eines etwaigen Nettoanlageertrags als Dividende erklärt. Sofern der Anteilsinhaber nichts anderes verlangt, erfolgen die Ausschüttungen an jeden Anteilsinhaber der einzelnen ausschüttenden Anteilsklassen in der Währung, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat.

Die ausschüttenden Plus-Anteilsklassen können Ausschüttungen aus dem Kapital erklären und zahlen. Anleger in diesen Anteilsklassen sollten wissen, dass Dividendenzahlungen aus Kapitalbeträgen an eine Rendite oder Rücknahme des ursprünglichen Investitionsvermögens oder der Kapitalgewinne eines Investors zurückzuführen sind, das dieser ursprünglichen Investition zuzuschreiben ist, und dass solche Ausschüttungen zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts pro Anteil der Anteilsklasse führen. Die Zahlung von Ausschüttungen aus dem Kapital führt entsprechend zu Kapitalerosion und kann durch Verzicht auf das Potenzial für zukünftiges Kapitalwachstum erzielt werden.

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

	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	51\$	313\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	67\$	60\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1\$	7\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	1\$
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	2\$	9\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	9\$	25\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$	1\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1\$	2\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	11\$	19\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28\$	390\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	20\$	101\$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

5. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	6\$	9\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	2\$	1\$
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	\$–
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	101\$	164\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	91\$	138\$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28\$	65\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	552\$	1.045\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	252\$	463\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	112\$	276\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	135\$	284\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29\$	58\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	13\$	21\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	1\$	20\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	1\$	76\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$	10\$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$–	1\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	644\$	473\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	578\$	719\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	95\$	52\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH ausschüttend (monatlich) abgesichert Plus	24\$	42\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	169\$	132\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	33\$	21\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	34\$	18\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	41\$	26\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	69\$	62\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	29\$	31\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3\$	6\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	14\$	19\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24\$	5\$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.309€	1.311€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	762€	327€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	149€	93€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	127€	57€
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	256€	86€
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus	1.079\$	19\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	1.580\$	406\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	228\$	73\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28\$	6\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	190\$	60\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	88\$	1\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	57\$	31\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.531\$	446\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S USD ausschüttend (M) Plus	116\$	11\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3€	94€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€–	29€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1€	5€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) Plus	€–	5€
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	€–	4€
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	56\$	50\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	45\$	28\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	5\$	8\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	28\$	30\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1\$	1\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	\$–	14\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	15\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	8\$
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	\$–	2\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) Plus	7\$	5\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus	1\$	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D USD ausschüttend (M) Plus	14\$	10\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D HKD ausschüttend (M) Plus	\$–	\$–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D CNH ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus	\$–	\$–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7\$	3\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse D SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3\$	8\$

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 ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen können bestimmte Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital statt den Ertrag berechnen. Das Berechnen aller oder eines Teils der Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einem höheren Ertrag zur Ausschüttung. Das Kapital, das diesen ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen für Investitionen in der Zukunft zur Verfügung steht, und Kapitalwachstum kann reduziert werden. Die Anteilinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Investoren in den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen kann dies ungeachtet der Wertentwicklung des jeweiligen Fonds zur Erosion der Kapitalinvestitionen der Anleger oder Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zugeordnet sind, führen, wodurch der Wert zukünftiger Renditen möglicherweise verringert wird. Die erhöhte Dividendenauszahlung infolge der Berechnung von Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Rendite oder einer Rücknahme der ursprünglichen Kapitalinvestitionen eines Investors oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Investition zuschreiben sind. Die höhere Dividendenauszahlung unter diesem Ladesystem führt zu einer entsprechenden unmittelbaren Verringerung des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividendendatum. Die Anteilinhaber sollten beachten, dass in dem Ausmaß, in dem die Aufwendungen dem Kapital berechnet werden, einige oder alle der Ausschüttungen, die von den ausschüttenden Plus (e)- und Plus (u)-Anteilsklassen vorgenommen werden, als Form der Kapitalerstattung betrachtet werden sollten. Sämtliche Aufwendungen der ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) wurden vermögenswirksam erfasst.

Im Geschäftsjahr haben die folgenden Fonds bei ausschüttenden Anteilsklassen Plus (e) Gebühren und Aufwendungen vom Kapital abgezogen:

	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 belastet wurden (in Tsd.)	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 belastet wurden (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	3\$	4\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$	1\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	44\$	42\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13\$	13\$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	834\$	953\$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

5. Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile – (Fortsetzung)

	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 belastet wurden (in Tsd.)	Gebühren und Aufwendungen, die dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 belastet wurden (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	2.562\$	4.797\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	307\$	644\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	56\$	92\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	192\$	304\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY ausschüttend (M) Plus (e)	3\$	3\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	497\$	910\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD ausschüttend (M) Plus (e)	1\$	\$–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	42\$	100\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	110\$	195\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A HKD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	274\$	2.586\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1\$	1\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2\$	5\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	6\$	80\$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – LM Klasse EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	446\$	554\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	88\$	105\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	137\$	183\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	52\$	64\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	157\$	124\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – LM Klasse Euro ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	108\$	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	215\$	154\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	11\$	9\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Premier Klasse USD ausschüttend (M) Plus (e)	104\$	83\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	25\$	32\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2\$	8\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	327\$	41\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1.657\$	2.012\$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse S USD ausschüttend (Q) Plus (e)	1\$	\$–
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1\$	\$–
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^] – Klasse X GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund – S Klasse Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	2\$	2\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	5\$	6\$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X Euro ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1\$	\$–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse GBP ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	133€	173 €
FTGF Clear Bridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) Plus (e)	38€	59 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Premier Klasse CAD ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	453€	400 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	1.433\$	802\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR ausschüttend (A) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse U EUR ausschüttend (Q) Plus (e)	\$–	\$–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X USD ausschüttend (M) Plus (e)	298\$	12\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X EUR ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	18\$	11\$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	7\$	\$–
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus (e)	117\$	107\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – Klasse A EUR ausschüttend (M) Plus (e)	9\$	9\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – S Klasse GBP ausschüttend (M) Plus (e)	3\$	2\$

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 Nettoanlageerträge täglich im Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Anteilsklasse kumuliert werden.

6. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigter Anteile

Grundkapital

Die Gesellschaft wurde mit einem anfänglichen Grundkapital in Höhe von 39.000 Euro (in Form von 39.000 Zeichneranteilen ohne Nennwert) gegründet. Bis auf drei hat die Gesellschaft alle Zeichneranteile zurückgekauft. Die Inhaber dieser drei Zeichneranteile sind berechtigt, an allen Versammlungen der Gesellschaft teilzunehmen und dort abzustimmen, sie sind jedoch nicht berechtigt, an den Dividenden bzw. dem Nettovermögen eines Fonds oder der Gesellschaft zu partizipieren.

Rückkaufbare und gewinnberechtigter Anteile

Das Grundkapital der Gesellschaft entspricht zu jeder Zeit dem Nettoinventarwert. Die Mitglieder des Verwaltungsrats sind ermächtigt, bis zu 500 Milliarden Anteile der Gesellschaft ohne Nennwert zum Nettoinventarwert je Anteil und zu den ihnen angemessenen erscheinenden Bedingungen auszugeben. Bei der Emission von Anteilen an der Gesellschaft besteht kein Vorkaufsrecht.

Jeder Anteil berechtigt den Anteilsinhaber dazu, gleichberechtigt auf anteilmäßiger Basis an den Dividenden und gegebenenfalls dem Reinvermögen des Fonds zu partizipieren, für den die Anteile ausgegeben wurden, mit Ausnahme von Dividenden, die beschlossen wurden, bevor dieser Anteilsinhaber seine Anteile kaufte.

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.

Jeder Fonds bietet unterschiedliche Anteilsklassen an. Diese sind im Verkaufsprospekt der Gesellschaft angegeben. Die verschiedenen Anteilsklassen unterscheiden sich hauptsächlich durch ihre Ausgabeaufschläge, Kosten, Gebührensätze, Ausschüttungspolitik und Währungen. Anleger können je nach Anlagebetrag und Anlagehorizont somit wählen, welche Anteilsklasse für ihre Anlagebedürfnisse am besten geeignet ist. Dabei ist die Höhe der Investition und der erwartete Beteiligungszeitraum in Betracht zu ziehen.

Anteilsklassen werden in ausschüttend und thesaurierend unterschieden. Thesaurierende Anteilsklassen schütten keinen Nettoertrag und keine realisierten oder nicht realisierten Nettokapitalgewinne aus. Ausschüttende Anteilsklassen schütten indes, wie in Erläuterung 5 zu den Ausschüttungen oben erklärt, in bestimmten zeitlichen Abständen einen Ertrag aus. Diese Abstände sind unterschiedlich und hängen davon ab, welcher Buchstabe in Klammern hinter der ausschüttenden Anteilsklasse angegeben ist. Darüber hinaus befinden sich Zeichneranteile der Gesellschaft in Umlauf. Die Zeichneranteile vermitteln deren Inhaber jedoch keinen Anspruch auf eine Beteiligung am Vermögen eines Fonds.

Jeder Fonds kann Anteilsklassen anbieten, die auf andere Währungen als die Basiswährung des Fonds lauten. Sofern der Name der Anteilsklasse nicht das Wort „(abgesichert)“ enthält, wendet der Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bei keiner solchen Anteilsklasse Methoden an, um das Risiko der Anteilsklasse in Bezug auf Änderungen der Wechselkurse zwischen der Basiswährung des Fonds und der Währung der Anteilsklasse abzusichern.

Anteile der Klasse A sind allen Anlegern zugänglich. Provisionen/Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse B, C, D, E und K sind für alle Anleger verfügbar, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile beauftragt wurden. Provisionszahlungen können von Vertriebshändlern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit einem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler zur Verfügung, der vom Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragt wurde. Provisionen/

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Rabattzahlungen können von Verwaltern an Händler oder andere Anleger, die eine Vereinbarung mit dem Vertriebshändler haben, in Bezug auf solche Aktien erfolgen. Anteile der Klasse J sind für die japanische Verteilung nach Ermessen der Direktoren oder Vertriebshändler bestimmt. Anteile der Klasse M sind für professionelle Investoren und Investoren mit einer diskretionellen Anlagevereinbarung mit einem Händler oder einer anderen von einem Vertriebshändler im Hinblick auf diese Aktien beauftragten Stelle verfügbar. Anteile der Klasse R sind für alle Investoren verfügbar, die ein gebührenbasiertes Arrangement mit einem Vermittler haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in die Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse T sind nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für den Vertrieb in Taiwan bestimmt. Anteile der Klasse X sind für Händler, Portfoliomanager oder Plattformen verfügbar, denen es gemäß den behördlichen Bestimmungen oder auf Grundlage von Gebührenverträgen mit ihren Kunden, nicht gestattet ist, die Vertriebsprovisionen von Unternehmen anzunehmen und einzubehalten sowie für institutionelle Investoren (für Anleger in der Europäischen Union bezieht sich das auf „geeignete Gegenparteien“, wie unter MIFID II definiert), die auf eigene Rechnung investieren. Anteile der Klassen U, Y und S sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für institutionelle Anleger verfügbar. Die BW LM-Anteilsklassen sind im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Investoren verfügbar, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder von Kunden solcher Mitglieder sind. LM-Anteilsklassen sind nach Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für sich qualifizierende Anleger erhältlich, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe, von Pensionsplänen und ähnlichen Anlagen sind, die von Mitgliedern der Legg Mason-Gruppe oder Kunden solcher Mitglieder gefördert werden. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler für „geeignete Gegenparteien“ gemäß Definition im Rahmen von MIFID II zur Verfügung. Für Investoren außerhalb der Europäischen Union sind die BW Premier-Anteilsklassen verfügbar für institutionelle Investoren im Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder oder Vertriebshändler oder für sich qualifizierende Investoren, die Mitglieder der Legg Mason-Gruppe oder Kunden dieser Mitglieder sind. Für Anleger, die in der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier-Anteilsklassen für „geeignete Gegenparteien“ zur Verfügung, die unter MIFID II definiert sind. Für Anleger, die außerhalb der Europäischen Union ansässig sind, stehen die Premier Share Klassen für institutionelle Anleger zur Verfügung.

Für Anteilsklassen, in deren Namen nach der Währungsbezeichnung das Wort „(abgesichert)“ enthalten ist, ist beabsichtigt, dass solche Anteilsklassen gegen Schwankungen der Wechselkurse zwischen der Währung der Anteilsklasse und der Basiswährung des jeweiligen Fonds abgesichert werden. Bestimmte Anteilsklassen in Fonds, die von Brandywine Global Investment Management, LLC verwaltet werden, werden im Verhältnis zu einem Index abgesichert, wie durch die ein „(IH)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben. Die von Brandywine Global Investment Management, LLC, verwalteten Fonds und der von ClearBridge Investments (North America) Pty Limited (vormals ClearBridge RARE Infrastructure International Pty Limited) verwaltete Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund bieten Portfolio-abgesicherte Anteilsklassen, wie durch die Angabe von „(PH)“ im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (der Handel wurde am 1. Juni 2021 eingestellt) bot Anteilsklassen an, für die möglicherweise eine Performancegebühr gezahlt wurde, wie durch „(PF)“ im Namen der Anteilsklasse angegeben.

Bestimmte Fonds haben auch Anteile von Grandfathered-Anteilsklassen ausgegeben, wie durch die Angabe von „GA“, „GE“, „GP“ oder „(G)“ im Namen der Anteilsklasse erkennbar. Die Grandfathered-Anteilsklassen sind nur für Anteilseigner der verbundenen Fonds verfügbar. Die Grandfathered-Klassen sind für nachfolgende Zeichnungen sowohl durch bestehende Anteilsinhaber in der Anteilsklasse als auch durch Neuanleger geschlossen, wobei Anteile jedoch noch wie folgt erworben werden können: durch (1) Wiederanlage von Dividenden, (2) automatische Umwandlung der Anteilsklasse B (G) eines Fonds in die Anteilsklasse A (G) des gleichen Fonds und (3) Umtausch von Anteilen einer Grandfathered-Anteilsklasse mit derselben Gattungsbezeichnung. Ungeachtet der vorstehenden Bestimmungen können bestimmte Grandfathered-Anteilsklassen für bestimmte Fonds, die in den Fondsumgebungen angegeben sind, für nachfolgende Zeichnungen von bestehenden Anteilseignern im alleinigen Ermessen der Verwaltungsratsmitglieder 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 ist in Irland bei Eintritt eines Steuertatbestands in den folgenden Fällen nicht steuerpflichtig:

- (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) es sich um bestimmte in Irland steuerlich ansässige, aber steuerbefreite Anteilsinhaber handelt, die der Gesellschaft die erforderlichen unterschriebenen vorschriftsmäßigen 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 des irischen Finanzamts 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. Der Posten „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ weist in der Darstellung der Vermögenslage Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus Futures-Kontrakten aus, die noch nicht geliefert wurden. Margeneinlagen und Barsicherheiten, die in Bezug auf OTCs und den Handel mit börsengehandelten Derivaten zum 28. Februar 2023 gehalten werden, werden bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS (28. Februar 2022: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNY Mellon, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS).

9. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 28. Februar 2023 bzw. 28. Februar 2022 bestanden keine wesentlichen Verbindlichkeiten oder Eventualverbindlichkeiten.

10. Soft-Commission-Vereinbarungen

Die Gesellschaft hat Richtlinien entwickelt, die sicherstellen sollen, dass ihre Dienstleister im besten Interesse der Fonds handeln, wenn sie Handelsentscheidungen im Auftrag dieser Fonds im Rahmen des Portfoliomanagements umsetzen. Zu diesem Zweck und um bestmögliche Ergebnisse für die Fonds zu erzielen, müssen unter Berücksichtigung von Preis, Kosten, Geschwindigkeit, Wahrscheinlichkeit der Ausführung und Abwicklung, Auftragsvolumen und -art und sonstigen für die Auftragsausführung relevanten Überlegungen alle angemessenen Maßnahmen getroffen werden. Eventuell erhaltene Barrückvergütungen von einem Makler oder Händler für an diesen Makler oder Händler gerichtete Fonds-Maklergeschäfte werden vom Anlageverwalter, dem Unteranlageverwalter oder mit diesen verbundenen Personen nicht einbehalten. Die Gesellschaft trägt nicht die Kosten externer Analysen für den Anlageverwalter und den Unteranlageverwalter. Derartige Kosten werden vom entsprechenden Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter getragen. Informationen zu den Richtlinien für Auftragsausführungen der Fonds sind für Anteilsinhaber auf Anfrage kostenlos erhältlich.

Während der Geschäftsjahre zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 ging Royce & Associates, LP („Royce“) „Soft Commission“-Vereinbarungen mit Brokern ein, erstattete jedoch den entsprechenden Fonds alle im Rahmen dieser Vereinbarungen entstandenen Researchkosten.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Wechselkurse

In diesem Abschluss wurden für die jeweiligen auf US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischer Yen lautenden Fonds die Beträge in Fremdwährungen anhand folgender Wechselkurse jeweils in US-Dollar, Euro,ritisches Pfund und japanischen Yen umgerechnet:

	Währung	Wechselkurse zum 28. Februar 2023	Wechselkurse zum 28. Februar 2022
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	366.3138*	208,2521
	Australischer Dollar	1,4861	1,3768
	Brasilianischer Real	5,2355	5,1517
	Britisches Pfund	0,8314	0,7454
	Kanadischer Dollar	1,3645	1,2675
	Chilenischer Peso	k. A.	799,2000
	Chinesischer Renminbi (CNH)	6,9499	6,3168
	Chinesischer Renminbi (CNY)	6,9394	6,3111
	Kolumbianischer Peso	4.859,4300	3937,0050
	Tschechische Krone	22,2152	22,4397
	Dänische Krone	7,0371	6,6330
	Ägyptisches Pfund	30,6300	15,7100
	Euro	0,9454	0,8919
	Hongkong-Dollar	7,8494	7,8146
	Ungarischer Forint	k. A.	331,7191
	Indische Rupie	82,6675	75,3475
	Indonesische Rupiah	15.250,0000	14367,0000
	Israelischer Schekel	3,6534	3,2108
	Japanischer Yen	136,1550	114,9650
	Malaysischer Ringgit	4,4875	4,1985
	Mexikanischer Peso	18,2965	20,4810
	Neuseeländischer Dollar	1,6173	1,4780
	Norwegische Krone	10,3848	8,8158
	Pakistanische Rupie	261,5000	177,3500
	Peruanischer Nuevo Sol	3,7949	k. A.
	Philippinischer Peso	55,3500	51,2700
	Polnischer Zloty	4,4486	4,1980
	Russischer Rubel	75,0500	107,9975
	Saudi-Rial	3,7527	3,7517
	Singapur-Dollar	1,3485	1,3557
	Südafrikanischer Rand	18,3650	15,3763
	Südkoreanischer Won	1.323,2500	1202,3500
	Schwedische Krone	10,4680	9,4722
Schweizer Franke	0,9419	0,9171	
Taiwan-Dollar	30,4695	28,0350	
Thailändischer Baht	35,3413	32,6750	
Türkische Lira	18,8850	13,8403	
Auf EUR lautende Fonds	Australischer Dollar	1,5719	1,5438
	Brasilianischer Real	5,5375	k. A.
	Britisches Pfund	0,8793	0,8358
	Kanadischer Dollar	1,4432	1,4212
	Tschechische Krone	k. A.	25,1605
	Dänische Krone	7,4431	7,4373
	Japanischer Yen	144,0112	128,9045
	Norwegische Krone	k. A.	9,8847
	Polnischer Zloty	4,7052	4,7070
	Russischer Rubel	k. A.	121,0922
	Südafrikanischer Rand	19,4247	17,2406
	Schwedische Krone	11,0720	10,6207
	Schweizer Franke	0,9962	1,0283
Türkische Lira	k. A.	15,5184	
US-Dollar	1,0577	1,1213	
Auf GBP lautende Fonds	Australischer Dollar	k. A.	1,8470
	Euro	1,1372	1,1964
	Japanischer Yen	163,7741	k. A.
	US-Dollar	1,2029	1,3415

* Ermäßigter 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 die Gesellschaft, wie in den UCITS Regulations dargelegt, hat FTIS (die „Verwaltungsgesellschaft“) die Entscheidung getroffen, einige, aber nicht alle Aktivitäten im Bereich der Anlageverwaltung an relevante Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter zu delegieren, wobei die Verwaltungsgesellschaft den Fonds gegenüber für die Erfüllung ihrer vereinbarten Verpflichtungen verantwortlich bleibt (Informationen über die Anlageverwalter und Unteranlageverwalter der einzelnen Fonds gemäß Prospekt finden Sie auf den Seiten mit den allgemeinen Informationen).

Gemeinsam mit der Verwaltungsgesellschaft und den Anlageverwaltern hat die Gesellschaft das Marktrisiko, das Kreditrisiko und das Liquiditätsrisiko als für sie wesentliche Risiken definiert. Beim Einsatz von Finanzderivaten bestehen die Risiken in einem Kontrahentenrisiko, einem Kreditrisiko, erhöhten Nachschussforderungen und einem unbegrenztem 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 sind jedoch die im Bericht des Verwaltungsrats genannten Anlageziele jedes Fonds zu beachten. Der jeweilige Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter steuert das Risiko, indem er Wertpapiere und andere Finanzinstrumente innerhalb bestimmter Anlagegrenzen und Anlagemandate sorgfältig auswählt. Einzelheiten zur Anlagepolitik der einzelnen Fonds sind im Bericht des Verwaltungsrats aufgeführt. 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 dieses Fonds hält, kann der jeweilige Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter das Fremdwährungsrisiko steuern, indem er entweder Fremdwährungen in der Leitwährung des Fonds absichert oder alternativ Anlagen über mehrere Währungen über ein Multi-Banken-Devisenhandelsnetz diversifiziert.

Das Zinsrisiko bezeichnet das Risiko, dass der Wert eines Finanzinstruments aufgrund von Veränderungen der Marktzinssätze schwanken wird. Die Fonds, die festverzinsliche Schuldtitel und Überziehungpositionen halten, sind einem Zinsrisiko ausgesetzt, da der Wert dieser Wertpapiere oder Darlehen aufgrund einer Änderung der Zinssätze schwanken kann. Beteiligungen an variabel verzinslichen Wertpapieren können ebenfalls einem Zinsrisiko unterliegen, wengleich in geringerem Umfang. Über die Verwahrstelle gehaltene Barmittel können Zinserträge generieren, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinssätzen schwankt.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

Die Aktienfonds legen generell nicht in zinstragenden Wertpapieren an. Ausgenommen hiervon sind die bei der Verwahrstelle gehaltenen Barbestände. Barmittel generieren Zinserträge, deren Höhe je nach dem vorherrschenden Marktzinsniveau schwankt. Daher unterliegen die Aktienfonds aufgrund der Schwankungen der vorherrschenden Marktzinssätze ihrer finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten keinem nennenswerten Risiko.

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 des jeweiligen Rentenfonds überwacht das Zinsumfeld und bewertet die Risiken wichtiger Strategien. Das Zinsrisiko wird durch die Überwachung der Laufzeiten und der Duration im Vergleich zu den Benchmarks der Fonds gesteuert. Zur Bewertung der Portfoliokurvenrisiken werden Techniken wie die Messung der Leitzinsduration eingesetzt.

Einzelheiten zur gewichteten Durchschnittsrendite der einzelnen Rentenfonds, zur gewichteten durchschnittlichen Restlaufzeit sowie einer Aufgliederung der festverzinslichen und unverzinslichen Wertpapiere sind den Erläuterungen 12.1(b) und 12.1(c) unten zu entnehmen.

Zu den mit der Anlage in Aktienfonds verbundenen Risiken gehören sich ändernde Wirtschaftsbedingungen, Branchen- und Unternehmensbedingungen sowie die Wertpapierauswahl. Rentenfonds und Multi-Asset-Fonds unterliegen außerdem dem Zinsrisiko, Kreditrisiko, Fälligkeitsrisiko und Marktrisiko. Internationale Wertpapiere unterliegen je nach Land sich ändernden Wechselkursen, weniger liquiden Märkten sowie politischer und wirtschaftlicher Instabilität. Die Märkte der Entwicklungsländer sind den gleichen Risiken ausgesetzt, wenn auch mitunter in stärkerem Maße. Zum Zweck einer effizienten Portfolioverwaltung können die Fonds börsenhandelte oder außerbörsliche („OTC“) Derivate abschließen, unter anderem Futures, Swaps, Forwards, Optionen und Optionsscheine, und Wertpapierleihgeschäfte tätigen.

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 Vermögensverwaltung (Aktien, Rentenwerte 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 überwachen, dass die Fonds in Übereinstimmung mit diesen Beschränkungen und Vorschriften verwaltet werden. Die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter berichten dem Ausschuss über Angelegenheiten, die sich im Zusammenhang mit der Überwachung bestimmter wesentlicher Risiken ergeben, die sich aus den Anlagen eines Fonds in Finanzinstrumenten ergeben.

12.1 Marktrisiko

Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt, versucht, das durch den Einsatz von Derivaten entstehende Marktrisiko und die Hebelwirkung zu begrenzen, indem er entweder den Commitment-Ansatz oder eine hochentwickelte Risikomesstechnik namens „Value-at-Value“ (der „VaR-Ansatz“) anwendet. Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt (ausgenommen der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]) wenden den Commitment-Ansatz an. Der FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] wenden den VaR-Ansatz an. Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] wendete den VaR-Ansatz bis zu dem Datum an, an dem der Handel eingestellt wurde (1. Juni 2021).

Der Manager wendet einen Risikomanagementprozess an, um die mit Positionen in Finanzderivate verbundenen Risiken genau messen, überwachen und steuern zu können.

Beim Commitment-Ansatz wird die Hebelwirkung berechnet, indem der Marktwert der zugrunde liegenden Derivatengagements im Verhältnis zum Nettoinventarwert des jeweiligen Fonds gemessen wird. Der VaR-Ansatz ist ein statistisches Verfahren, das unter Zugrundelegung historischer Daten versucht, mit einem bestimmten Konfidenzniveau (z. B. einseitiges Konfidenzniveau von 99 %) zu prognostizieren, 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 ein „absolutes“ VaR-Modell an, bei dem sich die VaR-Messung auf den Nettoinventarwert des Fonds bezieht. Ein VaR-Modell weist bestimmte inhärente Einschränkungen auf und es kann nicht zuverlässig vorhergesagt oder garantiert werden, dass die Höhe oder Häufigkeit der Verluste eines Fonds in irgendeiner Weise begrenzt wird. Da das VaR-Modell auf historischen Marktdaten als einem seiner wichtigsten Inputs beruht, kann die Wirksamkeit des VaR-Modells bei der Vorhersage des VaR eines Fonds erheblich beeinträchtigt sein, wenn die aktuellen Marktbedingungen von denen während des historischen Beobachtungszeitraums abweichen. Anormale Marktbedingungen können 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 Komponenten 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 einem Tag unter Verwendung einer geeigneten Stichprobe historischer Daten. Die folgende Tabelle enthält den absoluten VaR für die Fonds:

Fonds	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	2,48 %	2,66 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1,38 %	1,02 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	0,62 %	0,51 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	1,64 %	1,65 %

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

Fonds	Zum 28. Februar 2023	Zum 28. Februar 2022
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1,06 %	0,50 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	1,11 %	0,52 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	0,47 %	0,53 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	1,68 %	1,22 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund [^]	1,11 %	k. A.

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 jeweils ein absolutes VaR-Modell gemäß den Anforderungen der Zentralbank an. Für jeden dieser Fonds gilt eine absolute VaR-Grenze von 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Bei jedem dieser Fonds kann es jedoch gelegentlich zu einer Veränderung des Nettoinventarwerts über einen 20-tägigen Haltezeitraum von mehr als 20 % des Nettoinventarwerts kommen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

Neben der Anwendung des VaR-Ansatzes überwacht der Manager des FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], des FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], des FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], des Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] und FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] die Hebelwirkung täglich auf Veränderungen aufgrund von Marktbewegungen. Darüber hinaus müssen die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Untereinlageverwalter jedes dieser Fonds Pre-Trade-Tests durchführen, um die Auswirkungen, die der Handel auf die Gesamtverschuldung des jeweiligen Fonds haben würde, und das das Risiko-Ertrags-Verhältnis zu prüfen.

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

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023

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

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	4,70 %	5,82 %	11,90 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2,42 %	2,86 %	4,88 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	2,26 %	2,47 %	2,59 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	3,12 %	5,10 %	10,04 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	1,92 %	2,61 %	3,61 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund [^]	2,76 %	3,31 %	4,51 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	2,43 %	3,81 %	4,75 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	6,27 %	7,40 %	8,70 %

Gemäß den Vorschriften der Zentralbank hat Martin Currie Investment Management Limited den VaR auf der Grundlage einer Haltedauer von 10 Geschäftstagen und eines einseitigen Konfidenzintervalls von 95 % berechnet. Der Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] (der Handel wurde am 1. Juni 2021 eingestellt) unterlag einer absoluten VaR-Grenze von 8,5 % des Nettoinventarwerts des Fonds. Die niedrigsten, durchschnittlichen und höchsten VaR-Werte waren wie folgt:

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund ^{^β}	0,00 %	4,14 %	6,16 %

β bis zu dem Datum, an dem der Handel eingestellt wurde (1. Juni 2021).

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 2023	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	1.555,99 %	1.175,10 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	132,04 %	113,25 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	34,70 %	31,96 %
Western Asset SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	415,50 %	389,53 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	216,30 %	277,27 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	107,40 %	98,08 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	98,80 %	67,54 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	222,50 %	267,56 %
FTGF Global Multi-Sector Impact Fund [^]	87,00 %*	k. A.
Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund [^]	k. A.	88,25 %**

* Vom 1. Dezember 2022, dem Auflegungsdatum des FTGF Global Multi-Sector Impact Fund[^], bis zu dem Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023.

** Der Wert für den Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^] bezieht sich auf den Zeitraum vom 1. März 2021 bis zu dem Datum, an dem der Handel eingestellt wurde (1. Juni 2021).

Unter Stresstest versteht man die Untersuchung der potenziellen Auswirkungen einer Reihe spezifischer Änderungen der Risikofaktoren im Zusammenhang mit außergewöhnlichen, aber möglichen Ereignissen auf die Finanzlage eines Fonds. Western Asset verfolgt einen konservativen Ansatz und führt Stresstests durch, die über angemessenen wahrscheinlichen Ereignissen hinausgehen. Western Asset geht davon aus (wenngleich dies nicht zugesichert werden kann), dass der FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, wenn er Stresstests besteht, die über angemessenen wahrscheinlichen Ereignissen hinausgehen, der Nettoinventarwert pro Anteil (oder einer bestimmten Anteilsklasse) dieses Fonds bei negativen Marktbedingungen stabil bleiben würde.

Ein szenariobasierter Stresstest kann durchgeführt werden, um die in FRS 102 vorgesehene Vorschrift hinsichtlich der Sensitivitätsanalyse zu erfüllen. FRS 102 schreibt keine spezifische Basispunktentwicklung oder prozentuale Entwicklung für Sensitivitätsanalysen vor. Dementsprechend werden für die Zwecke dieses Jahresberichts die Währungsauswirkungen eines plötzlichen 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 2023	-62,727 \$
Zum 28. Februar 2022	-206,914 \$

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko jedes Fonds wird in Bezug auf einen Index überwacht, jedoch nicht gemanagt. Nachfolgend sind die Indizes zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 aufgeführt.

In den folgenden Tabellen ist der Index für jeden Fonds aufgeführt, außer für den FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], des FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], des FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] und des 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[^]. Dabei werden die wahrscheinlichen Auswirkungen auf den Wert des Nettoinventarwerts für jeden Fonds basierend auf positiven und negativen Indexentwicklungen quantifiziert und es wird für jeden Fonds das 1-Jahres-Beta angegeben. Beta ist ein Maß für die Volatilität der Bestände im Verhältnis zum Markt oder Index. Das Beta ist eine klare, quantifizierbare Kenngröße, berücksichtigt jedoch keine neuen Informationen, und Preisentwicklungen der Vergangenheit sind keine genauen Indikatoren für die zukünftige Entwicklung.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023

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

* 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.

*** Für den Fonds ist keine 1-Jahres-Performance verfügbar, daher ist für den Fonds auch kein Beta verfügbar.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022

Fonds	Index	Währung	Auswirkungen auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month (USD)	USD	13.793	-13.793
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	13.835	-13.835
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	94.029	-94.029
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTSE Euro Broad Investment-Grade Bond Index	EUR	5.630	-5.630
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	Bloomberg U.S. High Yield 1-5 Years Cash Pay 2 % Constrained Index	USD	2.599	-2.599
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	1.197.902	-1.197.902
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	12.765	-12.765
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund**	JP Morgan EMBI Global Index	USD	1.359	-1.359
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	JP Morgan Corporate Emerging Markets Bond Index – Broad Composite	USD	1.622	-1.622
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	4.327	-4.327
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	Bloomberg Global Inflation-Linked 1-10 Year Hedged (USD)	USD	1.922	-1.922
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	22.884	-22.884
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund**	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	14.249	-14.249
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	9.738	-9.738
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	4.215	-4.215
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	ICE BofA European Currency High Yield (ex. Financials) 2 % Constrained Index Currency Hedged (EUR)	EUR	1.313	-1.313
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	59.527	-59.527
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	ICE Bank of America Merrill Lynch Sterling Non-Gilt Index Gross Dividends (GBP)	GBP	3.359	-3.359
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Bloomberg U.S. Credit Index	USD	8.977	-8.977
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	8.068	-8.068
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index (USD)	USD	516	-516
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	8.680	-8.680
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	ICE Bank of America Merrill Lynch Global High Yield BB-B Index	USD	495	-495
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Russell 1000 Value Index	USD	119	-119
FTGF ClearBridge Value Fund	Russell 1000 Value Index (S&P 500 Index prior to 17 May 2021)	USD	39.869	-39.869
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	10.693	-10.693
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	81.804	-81.804
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell 3000 Growth Index	USD	16.761	-16.761
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.150	-1.150
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	Russell 3000 Index	USD	88.983	-88.983
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	883	-883
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5,5 % VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	-340.765	340.765
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	S&P Emerging Markets Infrastructure Net Total Return	USD	73	-73
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index (Russell 2000 Index prior to 17 May 2021)	USD	43.387	-43.387
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	3.991	-3.991
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	MSCI Europe Net Dividends Index	EUR	1.280	-1.280
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	MSCI AC Asia Pacific ex Japan Net Dividends Index	USD	636	-636
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	430	-430
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC Asia ex-Japan Net Dividends Index	USD	567	-567
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC World Net Dividends Index	USD	12.236	-12.236
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan Equity REITS Index Net Dividends (USD)/50 % MSCI AC Asia Pacific Ex Japan/UTILITIES Index Net dividends (USD)	USD	599	-599
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Dividends Index	USD	2.398	-2.398

* 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.

Die oben dargestellte Sensitivitätsanalyse dient nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung.

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko

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

Western Asset legt großen Wert darauf, das Fondsportfolio gegen Währungsrisiken abzusichern. In der Regel bleibt nur einen kleinen Teil des Portfolios ungesichert, und auch dann nur, wenn der Ausblick zuverlässig darauf schließen lässt, dass das Währungsrisiko attraktiv ist. In anderen Portfolios werden Absicherungen immer dann vorgenommen, wenn das Risiko einer Abwertung der Währung um mehr als die Kosten des Sicherungsgeschäfts besteht. Western Asset kann Cross-Hedges in Nicht-Leitwährungen abschließen, sofern die Richtlinien dies zulassen, unter Einhaltung strenger Grenzen (in der Regel weniger als 5 % des Portfolios) und mit dem Ziel, ein Engagement entsprechend der Benchmark abzubilden.

In den folgenden Tabellen ist das Nettoengagement der Fonds in Fremdwährungen zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 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 für sonstige Derivate angegebenen Beträge stellen die nicht realisierte Wertsteigerung/(Wertminderung) am Jahresende dar.

Zum 28. Februar 2023

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

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/ verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	– \$	– \$	2 \$	2
Britisches Pfund		–	–	–	41	–	–	41
Kanadischer Dollar		–	–	–	-6	–	–	-6
Euro		–	–	–	1.764	–	–	1.764
Mexikanischer Peso		–	–	–	–	–	3	3
Singapur-Dollar		–	–	–	379	–	–	379
US-Dollar		101.664	19440	2.303	-2.212	-45	1.907	123.057
Gesamt	USD	101.664 \$	19.440 \$	2.303 \$	-34 \$	-45 \$	1.912 \$	125.240
FTGF Western Asset Global High Yield Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	5.298 \$	– \$	3 \$	5.301
Britisches Pfund		1.976	482	–	1.411	–	96	3.965
Euro		3.035	269	133	1672	–	587	5.696
Indonesische Rupiah		–	–	–	–	–	21	21
Mexikanischer Peso		743	–	–	–	–	14	757
Russischer Rubel		88	–	–	–	–	83	171
Singapur-Dollar		–	–	–	1.725	–	-4	1.721
Türkische Lira		–	–	–	–	–	1	1
US-Dollar		42.049	3.940	1	-10.317	38	4.087	39.798
Gesamt	USD	47.891 \$	4.691 \$	134 \$	-211 \$	38 \$	4.888 \$	57.431
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	20.732 \$	– \$	13 \$	20.745
Chinesischer Renminbi		74.978	–	–	3.536	–	1.759	80.273
Euro		–	–	–	10.745	–	–	10.745
Hongkong-Dollar		–	956	–	–	–	33	989
Indische Rupie		33.683	–	–	–	–	458	34.141
Indonesische Rupiah		62.988	–	–	–	–	790	63.778
Malaysischer Ringgit		50.257	–	–	–	–	390	50.647
Philippinischer Peso		21.554	–	–	–	–	145	21.699
Singapur-Dollar		38.899	5.769	–	2.090	–	531	47.289
Südkoreanischer Won		76.610	–	–	–	-373	1.918	78.155
Schweizer Franke		–	–	–	287	–	–	287
Thailändischer Baht		23.532	–	–	–	–	151	23.683
US-Dollar		30.027	10.358	3.862	-38.358	–	-613	5.276
Gesamt	USD	412.528 \$	17.083 \$	3.862 \$	-968 \$	-373 \$	5.575 \$	437.707
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	9.724 \$	– \$	– \$	9.724
Britisches Pfund		89.845	8.554	–	197.072	239	-10.044	285.666
Euro		187.988	24.491	–	-111.391	4.675	-4.688	101.075
Japanischer Yen		–	–	–	-774	138	607	-29
Schwedische Krone		–	–	–	12.589	–	9	12.598
US-Dollar		176.288	27.956	17.040	-106.732	-61	445	114.936
Gesamt	USD	454.121 \$	61.001 \$	17.040 \$	488 \$	4.991 \$	-13.671 \$	523.970
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	1.421 \$	-22 \$	165 \$	1.564
Brasilianischer Real		1.455	749	–	–	–	42	2246
Britisches Pfund		10.703	1.415	–	-14.679	–	455	-2.106
Kanadischer Dollar		2.388	–	–	87.135	–	220	89.743
Chinesischer Renminbi		–	–	–	-13.277	–	–	-13.277
Euro		20.719	4.775	–	-8.159	-696	1.654	18.293
Indische Rupie		–	–	–	-299	–	–	-299
Indonesische Rupiah		1.740	–	–	–	–	89	1.829
Israelischer Sichel		–	–	–	–	–	71	71
Japanischer Yen		5.195	3.399	–	-6.916	144	416	2.238
Mexikanischer Peso		3.922	–	–	-248	–	82	3.756
Neuseeländischer Dollar		–	–	–	5.015	–	–	5.015
Norwegische Krone		–	–	–	1.586	–	22	1.608
Polnischer Zloty		1.942	–	–	-1.856	–	68	154
Südafrikanischer Rand		2.282	–	–	–	–	147	2.429
Südkoreanischer Won		1.808	–	–	-1.944	–	79	-57
Schwedische Krone		–	–	–	1.603	–	–	1.603
US-Dollar		67.165	6.152	11.217	-50.468	-116	-2.057	31.893
Gesamt	USD	119.319 \$	16.490 \$	11.217 \$	-1.086 \$	-690 \$	1.453 \$	146.703
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]								

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
Britisches Pfund	USD 3.796	2.542	–	\$ -6.813	\$ 15	\$ 401	\$ -59
Euro	13.255	5.127	–	-14.963	112	713	4.244
Japanischer Yen	–	–	–	307	37	81	425
US-Dollar	14.771	3715	559	21.722	-72	745	41440
Gesamt	USD 31.822	\$ 11.384	\$ 559	\$ 253	\$ 92	\$ 1.940	\$ 46.050
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	USD 15.845	–	\$ –	\$ 31.792	\$ –	\$ 2.589	\$ 50.226
Brasilianischer Real	22.887	–	–	50.630	-4.264	2.460	71.713
Britisches Pfund	–	5.770	–	32.947	-157	4.294	42.854
Kanadischer Dollar	–	–	–	37.643	–	4.075	41.718
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-18.680	–	–	-18.680
Kolumbianischer Peso	–	–	–	-20.092	–	–	-20.092
Ägyptisches Pfund	689	–	–	–	–	132	821
Euro	6.524	–	2.181	745.456	-13.694	34.499	774.966
Indische Rupie	129.539	–	–	-75.670	–	5.720	59.589
Indonesische Rupiah	174.005	–	–	-93.570	–	4.402	84.837
Japanischer Yen	–	–	–	-230.491	3.317	12502	-214.672
Malaysischer Ringgit	–	–	–	11.047	–	–	11.047
Mexikanischer Peso	114.924	–	–	-114.820	1.018	16.451	17.573
Norwegische Krone	–	–	–	9.608	–	6	9.614
Polnischer Zloty	55.983	–	–	-53.060	–	1.915	4.838
Russischer Rubel	5.439	–	–	-4.096	–	–	1.343
Singapur-Dollar	–	–	–	73.031	–	1	73.032
Südafrikanischer Rand	31.036	–	–	771	–	854	32.661
Schwedische Krone	–	–	–	1.418	–	5	1423
Schweizer Franke	–	–	–	21.026	–	53	21.079
Taiwan-Dollar	–	–	–	-47.438	–	–	-47.438
US-Dollar	1.002.252	331.800	16.369	-379.564	59.656	103.536	1.134.049
Gesamt	USD 1.559.123	\$ 337.570	\$ 18.550	\$ -22.112	\$ 45.876	\$ 193.494	\$ 2.132.501
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Argentinischer Peso	–	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	1
Australischer Dollar	–	–	–	5.231	-63	170	5.338
Brasilianischer Real	–	–	–	338	–	202	540
Britisches Pfund	1.370	950	–	175.544	-74	-1.178	176.612
Kanadischer Dollar	280	–	–	18.936	–	87	19.303
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.600	–	–	-2.600
Euro	842	3.144	507	42835	28	2.263	49.619
Indonesische Rupiah	3.019	–	–	-2.495	–	148	672
Japanischer Yen	–	–	–	4.418	–	1	4.419
Mexikanischer Peso	731	–	–	-4.362	-756	1.263	-3.124
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	–	–	9	9
Norwegische Krone	–	–	–	3.614	–	-1	3.613
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	2	2
Schweizer Franke	–	–	–	4.217	–	–	4.217
Türkische Lira	–	–	–	–	–	3	3
US-Dollar	173.588	81.010	2.424	-248.105	830	6.641	16.388
Gesamt	USD 179.830	\$ 85.104	\$ 2.931	\$ -2.429	\$ -35	\$ 9.611	\$ 275.012
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Britisches Pfund	USD –	\$ –	\$ –	\$ 85	\$ –	\$ –	\$ 85
Euro	–	–	–	6.064	–	–	6.064
Japanischer Yen	–	–	–	41.628	–	–	41.628
Schweizer Franke	–	–	–	300	–	–	300
US-Dollar	77.126	462713	17.212	-49.752	244	3.928	511.471
Gesamt	USD 77.126	\$ 462.713	\$ 17.212	\$ -1.675	\$ 244	\$ 3.928	\$ 559.548
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.042.661	\$ 104.522	\$ 1.154	\$ –	\$ -378	\$ -28.452	\$ 1.119.507
Gesamt	USD 1.042.661	\$ 104.522	\$ 1.154	\$ –	\$ -378	\$ -28.452	\$ 1.119.507
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	£ 30.870	£ 10.333	£ –	£ 3.366	£ -12	£ 1.385	£ 45.942
Euro	566	428	–	-1.152	15	148	5
Japanischer Yen	–	–	–	-151	19	120	-12
US-Dollar	544	1180	–	-2.043	-6	302	-23
Gesamt	£ 31.980	£ 11.941	£ –	£ 20	£ 16	£ 1.955	£ 45.912

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/ verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	– \$	– \$	– \$	276 \$	– \$	– \$	276
Britisches Pfund		28	–	–	77.897	–	329	78.254
Euro		50	–	–	442	–	203	695
Japanischer Yen		–	–	–	477	–	–	477
Mexikanischer Peso		620	–	–	180	–	164	964
US-Dollar		65.420	27.821	253	-79.641	-173	429	14109
Gesamt	USD	66.118 \$	27.821 \$	253 \$	-369 \$	-173 \$	1.125 \$	94.775
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	520 \$	-16 \$	43 \$	547
Brasilianischer Real		91	–	–	–	–	7	98
Britisches Pfund		–	–	–	-38	-1	60	21
Kanadischer Dollar		–	–	–	742	–	11	753
Chinesischer Renminbi		–	–	–	-662	–	–	-662
Euro		–	–	–	-345	3	73	-269
Indonesische Rupiah		249	–	–	29	–	32	310
Japanischer Yen		–	–	–	69	–	6	75
Mexikanischer Peso		1.214	–	–	-239	–	80	1.055
Norwegische Krone		–	–	–	185	–	–	185
Russischer Rubel		22	–	–	–	–	–	22
US-Dollar		11.478	2.884	1.342	-308	928	-18	16.306
Gesamt	USD	13.054 \$	2.884 \$	1.342 \$	-47 \$	914 \$	294 \$	18.441
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	– \$	– \$	– \$	2.532 \$	– \$	– \$	2.532
Britisches Pfund		210	212	–	-400	-1	4	25
Euro		2.461	1.346	–	-4.176	59	348	38
US-Dollar		3.145	1.167	30	2.029	-4	33	6.400
Gesamt	USD	5.816 \$	2.725 \$	30 \$	-15 \$	54 \$	385 \$	8.995
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	186 \$	– \$	– \$	186
Brasilianischer Real		9.738	–	–	-6.113	–	-55	3.570
Britisches Pfund		7.053	–	–	16.986	–	121	24.160
Kanadischer Dollar		4.585	–	–	-1.219	–	28	3.394
Chinesischer Renminbi		–	–	–	-950	–	–	-950
Kolumbianischer Peso		7.920	–	–	-2.571	–	456	5.805
Dänische Krone		–	–	–	-189	–	–	-189
Euro		8.814	–	–	36.527	–	249	45.590
Israelischer Schekel		–	–	–	-194	–	–	-194
Japanischer Yen		–	–	–	25.308	–	–	25.308
Mexikanischer Peso		24.449	–	–	-21.477	–	468	3.440
Neuseeländischer Dollar		2.062	–	–	-1.953	–	26	135
Norwegische Krone		6.120	–	–	-115	–	94	6.099
Polnischer Zloty		7.036	–	–	-1.454	–	456	6.038
Russischer Rubel		6.292	–	–	–	–	55	6.347
Singapur-Dollar		–	–	–	-271	–	–	-271
Südafrikanischer Rand		9.422	–	–	-9.386	–	20	56
Südkoreanischer Won		8.781	–	–	-4.666	–	52	4.167
Schwedische Krone		–	–	–	-118	–	–	-118
Thailändischer Baht		–	–	–	1.431	–	–	1.431
US-Dollar		47.246	10.717	4.095	-30.596	–	-3.457	28.005
Gesamt	USD	149.518 \$	10.717 \$	4.095 \$	-834 \$	– \$	-1.487 \$	162.009
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	149.903 \$	– \$	– \$	149.903
Brasilianischer Real		39.348	–	–	-13.194	–	644	26.798
Britisches Pfund		–	–	–	12.300	–	1.647	13.947
Kanadischer Dollar		–	–	–	16.353	–	–	16.353
Kolumbianischer Peso		31.019	–	–	20.996	–	1.747	53.762
Euro		–	4.018	–	154.722	–	-1.776	156.964
Japanischer Yen		–	–	–	–	2.086	-11	2.075
Mexikanischer Peso		31.005	–	–	-32.918	–	1.169	-744
Norwegische Krone		14.430	–	–	-3.487	–	166	11.109
Peruanischer Nuevo Sol		–	–	–	48.046	–	1	48.047
Polnischer Zloty		19.905	–	–	-20.189	–	66	-218
Südafrikanischer Rand		23.077	–	–	-23.648	–	585	14
Südkoreanischer Won		15.712	–	–	-15.997	–	-2	-287
Schweizer Franken		–	–	–	-64.929	–	–	-64.929
US-Dollar		245.418	84.210	30.565	-238.561	104	4.741	126.477
Gesamt	USD	419.914 \$	88.228 \$	30.565 \$	-10.603 \$	2.190 \$	8.977 \$	539.271

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/ verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]								
Britisches Pfund	USD	– \$	– \$	– \$	67 \$	– \$	– \$	67
Kanadischer Dollar		–	–	–	9.884	–	–	9.884
Euro		79	–	–	-7	–	–	72
Schwedische Krone		–	–	–	-2	–	–	-2
Schweizer Franken		–	–	–	-2	–	–	-2
US-Dollar		9.551	334	396	-10.132	2	224	375
Gesamt	USD	9.630 \$	334 \$	396 \$	-192 \$	2 \$	224 \$	10.394
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	-255 \$	– \$	– \$	-255
Brasilianischer Real		11.157	–	–	-5.044	–	174	6.287
Britisches Pfund		1.556	–	–	9.178	–	6	10.740
Kanadischer Dollar		1.527	–	–	4.328	–	26	5.881
Chinesischer Renminbi		–	–	–	-688	–	–	-688
Kolumbianischer Peso		12.040	–	–	-3.628	–	726	9.138
Dänische Krone		–	–	–	-51	–	–	-51
Euro		11.990	40	–	21.821	–	142	33.993
Israelischer Schekel		–	–	–	-52	–	–	-52
Japanischer Yen		–	–	–	41.040	–	–	41.040
Malaysischer Ringgit		5.778	–	–	-5.221	–	83	640
Mexikanischer Peso		25.446	–	–	-19.832	–	624	6.238
Neuseeländischer Dollar		1.673	–	–	13.940	–	20	15.633
Norwegische Krone		1.518	–	–	8.288	–	24	9.830
Polnischer Zloty		8.284	–	–	890	–	727	9.901
Russischer Rubel		55	–	–	–	–	–	55
Singapur-Dollar		–	–	–	-73	–	–	-73
Südafrikanischer Rand		7.572	–	–	-7.184	–	-2	386
Südkoreanischer Won		13.957	–	–	-7.291	–	82	6.748
Schwedische Krone		–	–	–	-32	–	–	-32
Thailändischer Baht		–	–	–	2.331	–	1	2.332
US-Dollar		71.025	27.021	4.087	-55.256	–	578	47.455
Gesamt	USD	173.578 \$	27.061 \$	4.087 \$	-2.791 \$	– \$	3.211 \$	205.146
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund								
Australischer Dollar	USD	388 \$	– \$	– \$	4.727 \$	– \$	2 \$	5.117
Brasilianischer Real		44.532	–	–	-625	–	719	44.626
Britisches Pfund		–	1.173	–	46.639	–	89	47.901
Chinesischer Renminbi		–	–	–	868	–	–	868
Kolumbianischer Peso		35.719	–	–	–	–	2.820	38.539
Tschechische Krone		–	–	–	29	–	–	29
Euro		22.650	–	–	408.937	-878	532	431.241
Japanischer Yen		–	–	–	–	-2.581	136	-2.445
Mexikanischer Peso		38.254	–	–	-2.826	–	1.585	37.013
Singapur-Dollar		–	–	–	61.210	–	88	61.298
Schwedische Krone		–	–	–	2.020	–	–	2.020
Schweizer Franke		–	–	–	483	–	–	483
US-Dollar		741.247	184.488	85.354	-530.341	186	62681	543.615
Gesamt	USD	882.790 \$	185.661 \$	85.354 \$	-8.879 \$	-3.273 \$	68.652 \$	1.210.305
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	890 \$	– \$	– \$	-890 \$	– \$	15 \$	15
Britisches Pfund		–	–	–	-1.169	–	–	-1.169
Kolumbianischer Peso		802	–	–	-889	–	31	-56
Euro		–	2.802	–	-3.578	17	15	-744
Japanischer Yen		–	–	–	–	-74	4	-70
US-Dollar		12.080	26.981	2238	6.550	-86	1.017	48.780
Gesamt	USD	13.772 \$	29.783 \$	2.238 \$	24 \$	-143 \$	1.082 \$	46.756
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]								
Britisches Pfund	USD	– \$	– \$	– \$	-9 \$	– \$	– \$	-9
Kanadischer Dollar		–	–	–	-64	–	–	-64
Euro		97	–	–	8.360	–	1	8.458
US-Dollar		7.778	202	411	-8.479	–	92	4
Gesamt	USD	7.875 \$	202 \$	411 \$	-192 \$	– \$	93 \$	8.389

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/ verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	71.448 \$	– \$	– \$	71.448
Brasilianischer Real		7.638	–	–	–	–	119	7.757
Britisches Pfund		–	–	–	7.018	–	–	7.018
Kanadischer Dollar		–	–	–	7.370	–	–	7.370
Chilenischer Peso		–	–	–	6.716	–	1	6.717
Kolumbianischer Peso		5.023	–	–	-1.784	–	295	3.534
Tschechische Krone		3.362	–	–	-3.361	–	53	54
Euro		–	–	–	–	-283	-1	-284
Japanischer Yen		–	–	–	14.477	–	–	14.477
Malaysischer Ringgit		1.810	–	–	134	–	26	1.970
Mexikanischer Peso		13.934	–	–	–	–	287	14.221
Neuseeländischer Dollar		–	–	–	4.260	–	–	4.260
Norwegische Krone		–	–	–	3.326	–	–	3.326
Singapur-Dollar		–	–	–	73	–	–	73
Südafrikanischer Rand		5.953	–	–	-557	–	-2	5.394
Südkoreanischer Won		4.525	–	–	-2.231	–	26	2.320
Thailändischer Baht		–	–	–	2.413	–	–	2.413
US-Dollar		11.900	11663	3.886	-112.535	–	2.428	-82.658
Gesamt	USD	54.145 \$	11.663 \$	3.886 \$	-3.233 \$	-283 \$	3.232 \$	69.410
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	695 \$	– \$	– \$	-184 \$	– \$	9 \$	520
Britisches Pfund		160	–	–	-108	–	2	54
Kolumbianischer Peso		437	–	–	–	–	34	471
Euro		541	184	–	-619	-62	8	52
Japanischer Yen		–	–	–	–	-47	2	-45
Mexikanischer Peso		612	–	–	-178	–	20	454
US-Dollar		7.741	2760	–	1.111	19	1.667	13.298
Gesamt	USD	10.186 \$	2.944 \$	– \$	22 \$	-90 \$	1.742 \$	14.804
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]								
Euro		– \$	– \$	– \$	1.338 \$	– \$	– \$	1.338
US-Dollar		–	–	2.583	-1.358	–	-29	1.196
Gesamt	USD	– \$	– \$	2.583 \$	-20 \$	– \$	-29 \$	2.534
FTGF ClearBridge Value Fund								
Britisches Pfund	USD	– \$	– \$	7.710 \$	– \$	– \$	– \$	7.710
Kanadischer Dollar		–	–	–	–	–	230	230
Euro		–	–	34.655	61883	–	-580	95.958
Japanischer Yen		–	–	10.195	–	–	–	10.195
Singapur-Dollar		–	–	–	1.757	–	-21	1.736
US-Dollar		–	–	869.426	-64.606	–	9.077	813.897
Gesamt	USD	– \$	– \$	921.986 \$	-966 \$	– \$	8.706 \$	929.726
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund								
Euro		– \$	– \$	– \$	– \$	– \$	42 \$	42
US-Dollar		–	–	180.681	–	–	8.887	189.568
Gesamt	USD	– \$	– \$	180.681 \$	– \$	– \$	8.929 \$	189.610
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund								
Brasilianischer Real	USD	– \$	– \$	– \$	22.751 \$	– \$	477 \$	23.228
Britisches Pfund		–	–	–	–	–	-55	-55
Euro		–	–	–	29.795	–	51	29.846
US-Dollar		–	–	1.172.787	-53.811	–	53.740	1.172.716
Gesamt	USD	– \$	– \$	1.172.787 \$	-1.265 \$	– \$	54.213 \$	1.225.735
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund								
Australischer Dollar	USD	– \$	– \$	– \$	4.676 \$	– \$	-1 \$	4.675
Britisches Pfund		–	–	–	348	–	170	518
Chinesischer Renminbi		–	–	–	980	–	–	980
Euro		–	–	–	738	–	1	739
Singapur-Dollar		–	–	–	1.365	–	–	1.365
Schwedische Krone		–	–	–	18	–	–	18
Schweizer Franke		–	–	–	48	–	–	48
US-Dollar		–	–	214.039	-8.398	–	10.809	216.450
Gesamt	USD	– \$	– \$	214.039 \$	-225 \$	– \$	10.979 \$	224.793

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/-verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	– \$	– \$	2.089 \$	– \$	– \$	6 \$	2.095
Britisches Pfund	–	–	–	751	–	–	–	751
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.557	–	–	–	1.557
Hongkong-Dollar	–	–	–	8.238	–	–	-1	8.237
Indische Rupie	–	–	–	5.907	–	–	-43	5.864
Indonesische Rupiah	–	–	–	1.229	–	–	–	1.229
Mexikanischer Peso	–	–	–	1.587	–	–	–	1.587
Philippinischer Peso	–	–	–	148	–	–	–	148
Saudi-Rial	–	–	–	617	–	–	–	617
Südkoreanischer Won	–	–	–	5.522	–	–	25	5547
Taiwan-Dollar	–	–	–	4.327	–	–	–	4.327
US-Dollar	–	–	–	2.575	–	–	168	2.743
Gesamt	USD	– \$	– \$	34.547 \$	– \$	– \$	155 \$	34.702
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]								
Brasilianischer Real	€	– €	– €	– €	1.333 €	– €	– €	1.333
Britisches Pfund	–	–	–	9.887	–	–	871	10.758
Dänische Krone	–	–	–	7.103	–	–	39	7.142
Euro	–	–	–	127.442	-1.383	–	-760	125.299
Schwedische Krone	–	–	–	25.502	–	–	132	25634
Schweizer Franke	–	–	–	6.353	–	–	34	6.387
US-Dollar	–	–	–	12.493	52	–	-1	12.544
Gesamt	€	– €	– €	188.780 €	2 €	– €	315 €	189.097
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]								
Euro	€	25.460 €	9.299 €	– €	– €	– €	2.064 €	36.823
Gesamt	€	25.460 €	9.299 €	– €	– €	– €	2.064 €	36.823

Zum 28. Februar 2022

									(in Tsd.)				
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund													
US-Dollar	\$	806.429	\$	133.015	\$	–	\$	–	\$	-20.120	\$	919.324	
Gesamt	USD	806.429	\$	133.015	\$	–	\$	–	\$	-20.120	\$	919.324	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund													
Chinesischer Renminbi		82	– \$	– \$	– \$	– \$	– \$	– \$	– \$	16	\$	98	
Euro	–	–	–	–	–	2.562	–	–	–	–	–	2.562	
US-Dollar		180.989		48.325		5.470		-2.612		1.106		-3.032	230.246
Gesamt	USD	181.071	\$	48.325	\$	5.470	\$	-50	\$	1.106	\$	-3.016	232.906
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund													
Argentinischer Peso	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	8	\$	8
Australischer Dollar	–	–	–	–	–	25.839	–	-523	–	–	1.205	–	26.521
Brasilianischer Real		5.274		1692	–	–	–	-364	–	-855	–	2.539	8.286
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	9.076	–	–	–	–	–	1.698	10.774
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	53.137	–	–	–	–	–	866	54.003
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	-41.391	–	–	–	–	–	–	-41.391
Euro	–	–	–	–	–	23.776	–	1526	–	–	–	2.197	27.499
Indische Rupie	–	–	–	–	–	2.056	–	–	–	–	–	–	2.056
Indonesische Rupiah		11.786	–	–	–	2.802	–	–	–	–	–	633	15.221
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	18.877	–	167	–	–	–	1.339	20.383
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	27	27
Mexikanischer Peso		27.048	–	–	–	–	–	–	–	-313	–	–	38.467
Russischer Rubel		9.825	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	18.197
Südafrikanischer Rand	–	–	–	–	–	1.903	–	–	–	–	–	–	1.903
US-Dollar		1.022.043		366296		34088		-115.510		3.882		-4.663	1.306.136
Gesamt	USD	1.075.976	\$	367.988	\$	34.088	\$	-3.895	\$	3.884	\$	10.049	1.488.090

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)							
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund														
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	-72	€	146	€	36				
Britisches Pfund		345	–	–	–	-433	-136	293		69				
Kanadischer Dollar		–	–	–	–	-224	-13	254		17				
Tschechische Krone		–	–	–	–	-59	-11	78		8				
Euro		110.688	14.737	–	–	17.280	84	1.887		144.676				
Ungarischer Forint		–	–	–	–	1.348	–	–		1.348				
Norwegische Krone		–	–	–	–	2.011	–	–		2.011				
Polnischer Zloty		–	–	–	–	1.352	–	26		1.378				
US-Dollar		19.645	391	808	-21.713	-583	–	1.295		-157				
Gesamt	€	130.678	€	15.128	€	808	€	-510	€	-697	€	3.979	€	149.386
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	30	\$	–	\$	-1	\$	29
Kanadischer Dollar		171	–	–	–	-175	–	7	–	–	–	7	–	3
Euro		–	–	–	–	1.473	–	5	–	–	–	5	–	1.478
Hongkong-Dollar		–	–	–	–	-8	–	–	–	–	–	–	–	-8
US-Dollar		42.570	7.761	216	-1.348	–	–	2.291	–	–	–	2.291	–	51.490
Gesamt	USD	42.741	\$	7.761	\$	216	\$	-28	\$	–	\$	2.302	\$	52.992
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	92.930	\$	-117	\$	595	\$	93.408
Brasilianischer Real		7.847	–	–	–	-1.008	–	312	–	–	–	312	–	7.151
Britisches Pfund		7.527	3.843	–	–	40.232	–	2.095	–	–	–	2.095	–	53.697
Kanadischer Dollar		–	–	–	–	970	–	3	–	–	–	3	–	973
Chinesischer Renminbi		9.405	–	–	–	-5.094	–	413	–	–	–	413	–	4.724
Kolumbianischer Peso		–	–	–	–	–	–	78	–	–	–	78	–	78
Tschechische Krone		–	–	–	–	–	–	38	–	–	–	38	–	38
Euro		11.387	5.594	17.332	–	-19.395	-364	1.782	–	–	–	1.782	–	16.336
Indische Rupie		–	–	–	–	1.442	–	–	–	–	–	–	–	1.442
Indonesische Rupiah		7.388	–	–	–	2.386	–	419	–	–	–	419	–	10.193
Mexikanischer Peso		8.613	–	–	–	334	–	403	–	–	–	403	–	9.350
Polnischer Zloty		–	–	–	–	3.701	–	–	–	–	–	–	–	3.701
Russischer Rubel		3.458	–	–	–	-3.038	–	123	–	–	–	123	–	543
Singapur-Dollar		–	–	–	–	-5.692	–	–	–	–	–	–	–	-5.692
Südafrikanischer Rand		3.160	–	–	–	-2.051	–	785	–	–	–	785	–	1.894
Schweizer Franke		–	–	–	–	3.448	–	–	–	–	–	–	–	3.448
Taiwan-Dollar		–	–	–	–	-3.537	–	–	–	–	–	–	–	-3.537
US-Dollar		141.243	44.585	12.063	-103.298	-1.353	–	11.982	–	–	–	11.982	–	105.222
Gesamt	USD	200.028	\$	54.022	\$	29.395	\$	2.330	\$	-1.834	\$	19.028	\$	302.969
FTGF Western Asset US High Yield Fund														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	3	\$	3
Britisches Pfund		–	–	–	–	52	–	–	–	–	–	–	–	52
Kanadischer Dollar		–	–	–	–	-7	–	–	–	–	–	–	–	-7
Euro		–	–	–	–	1.811	–	–	–	–	–	–	–	1.811
Mexikanischer Peso		–	–	–	–	–	–	2	–	–	–	2	–	2
Singapur-Dollar		–	–	–	–	514	–	–	–	–	–	–	–	514
US-Dollar		218.734	32.137	5005	-2.411	68	–	3192	–	–	–	3192	–	256.725
Gesamt	USD	218.734	\$	32.137	\$	5.005	\$	-41	\$	68	\$	3.197	\$	259.100
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund														
Brasilianischer Real	USD	–	\$	–	\$	–	\$	-21	\$	–	\$	29	\$	8
Britisches Pfund		–	–	–	–	139	–	–	–	–	–	–	–	139
Chinesischer Renminbi		–	–	–	–	121	–	–	–	–	–	–	–	121
Ägyptisches Pfund		255	–	–	–	–	–	43	–	–	–	43	–	298
Euro		–	–	–	–	2.663	–	–	–	–	–	–	–	2.663
Indische Rupie		527	–	–	–	-546	–	8	–	–	–	8	–	-11
Indonesische Rupiah		681	–	–	–	-710	–	37	–	–	–	37	–	8
Mexikanischer Peso		183	–	–	–	-223	–	12	–	–	–	12	–	-28
Russischer Rubel		–	–	–	–	-33	–	4	–	–	–	4	–	-29
Singapur-Dollar		–	–	–	–	9	–	–	–	–	–	–	–	9
Südafrikanischer Rand		–	–	–	–	–	–	19	–	–	–	19	–	19
US-Dollar		27.702	3.881	4.048	-1.418	-94	–	3.802	–	–	–	3.802	–	37.921
Gesamt	USD	29.348	\$	3.881	\$	4.048	\$	-19	\$	-94	\$	3.954	\$	41.118
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]														
Euro	–	\$	–	\$	–	\$	1.963	\$	–	\$	-1	\$	–	1.962
US-Dollar	24.491	–	2599	–	–	-2.002	-17	815	–	–	–	815	–	25886
Gesamt	USD	24.491	\$	2.599	\$	–	\$	-39	\$	-17	\$	814	\$	27.848

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt						
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	7.754	\$	2	\$	7.756				
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	–	–	17	–	17				
Britisches Pfund	3.389	542	–	–	561	–	–	222	–	4.714				
Euro	2.683	134	4.505	–	874	–	–	430	–	8.626				
Indonesische Rupiah	705	–	–	–	–	–	–	35	–	740				
Mexikanischer Peso	874	–	–	–	–	–	–	17	–	891				
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	–	6	–	6				
Russischer Rubel	634	–	–	–	–	–	–	79	–	713				
Singapur-Dollar	–	–	–	–	2.201	–	–	–	–	2.201				
Türkische Lira	–	–	–	–	–	–	–	1	–	1				
US-Dollar	54.852	5.337	2.128	–	–	–	–	51	–	5.633				
Gesamt	USD	63.137	\$	6.013	\$	6.633	\$	54	\$	51	\$	6.090	\$	81.978
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^]														
Australischer Dollar	USD	–	\$	353	\$	–	\$	-956	\$	-26	\$	113	\$	-516
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	–	–	-47	–	-51	–	124	–	26
Kanadischer Dollar	–	–	366	–	–	–	–	-1.041	–	-9	–	119	–	-565
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	–	–	-22	–	-5	–	30	–	3
Euro	1.129	14.002	–	–	–	–	–	-7.231	114	–	–	211	–	8.225
Ungarischer Forint	–	–	–	–	–	–	–	530	–	–	–	–	–	530
Indonesische Rupiah	125	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	12	–	137
Japanischer Yen	–	5.064	–	–	–	–	–	-5.187	28	–	–	76	–	-19
Mexikanischer Peso	922	–	–	–	–	–	–	73	–	–	–	171	–	1.166
Neuseeländischer Dollar	–	177	–	–	–	–	–	-52	–	–	–	4	–	129
Norwegische Krone	–	–	–	–	–	–	–	368	–	–	–	–	–	368
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	–	532	–	–	–	8	–	540
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	–	–	10	–	–	–	–	–	10
Südafrikanischer Rand	817	–	–	–	–	–	–	-790	–	–	–	81	–	108
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	–	–	–	-3	–	–	–	–	–	-3
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	3	–	3
US-Dollar	1.725	30.213	3.010	–	–	–	–	13.871	-234	–	–	798	–	49.383
Gesamt	USD	4.718	\$	50.175	\$	3.010	\$	55	\$	-183	\$	1.750	\$	59.255
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	21.831	\$	–	\$	96	\$	21.927
Chinesischer Renminbi	121.775	–	–	–	–	–	–	5.390	–	–	–	2.557	–	129.722
Euro	–	–	–	–	–	–	–	11.798	–	–	–	-15	–	11.783
Hongkong-Dollar	–	960	–	–	–	–	–	–	–	–	–	7	–	967
Indische Rupie	48.494	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	2.433	–	50.927
Indonesische Rupiah	62.358	–	–	–	–	–	–	–	7.755	–	–	970	–	71.083
Malaysischer Ringgit	54.031	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	692	–	54.723
Philippinischer Peso	46.748	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	318	–	47.066
Singapur-Dollar	14.571	7.600	–	–	–	–	–	40.602	–	–	–	433	–	63.206
Südkoreanischer Won	67.112	–	–	–	–	–	–	7.066	-1.113	–	–	2.979	–	76.044
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	–	–	331	–	–	–	-1	–	330
Thailändischer Baht	26.180	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	164	–	26.344
US-Dollar	24.366	6.264	12.311	–	–	–	–	-87.234	–	–	–	-35	–	-44.328
Gesamt	USD	465.635	\$	14.824	\$	12.311	\$	-216	\$	6.642	\$	10.598	\$	509.794
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	10.316	\$	–	\$	701	\$	11.017
Britisches Pfund	65.822	1.793	–	–	–	–	–	194.510	-181	–	–	3.194	–	265.138
Euro	145.958	18.816	–	–	–	–	–	-107.634	2.014	–	–	-4.998	–	54.156
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	–	22.926	–	–	–	74	–	23.000
US-Dollar	179.489	26.839	6.636	–	–	–	–	-120.587	180	–	–	-1.619	–	90.938
Gesamt	USD	391.269	\$	47.448	\$	6.636	\$	-469	\$	2.013	\$	-2.648	\$	444.249

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)	
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	\$	-2.641	\$ -201	\$ 517	\$ -2.325
Brasilianischer Real					-8		8	
Britisches Pfund		7.880	1.175		-10.423	-217	587	-998
Kanadischer Dollar		2.914			99.084	-50	337	102.285
Chinesischer Renminbi					-18.194			-18.194
Tschechische Krone					-88	-18	118	12
Euro		22.518	4.533		18.692	66	1.887	47.696
Ungarischer Forint					2.273			2.273
Indonesische Rupiah		2.219			-55		108	2.272
Israelischer Schekel							81	81
Japanischer Yen		4.308	8.744		-13.466	-52	168	-298
Mexikanischer Peso		4.257			-139		109	4.227
Neuseeländischer Dollar					6.139			6.139
Norwegische Krone					2.073			2.073
Polnischer Zloty					2.310		35	2.345
Russischer Rubel		1.465			-1.323		155	297
Südafrikanischer Rand		3.266			-3.128		160	298
Südkoreanischer Won		2.056			-2.124		47	-21
Taiwan-Dollar					9			9
US-Dollar		109.935	4.367	20.460	-79.101	-1.235	351	54.777
Gesamt	USD	160.818	\$ 18.819	\$ 20.460	\$ -110	\$ -1.707	\$ 4.668	\$ 202.948
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	\$	-3	\$	\$ 23	\$ 20
Brasilianischer Real					310			310
Britisches Pfund		6.219	2.961		-9.457	-14	294	3
Euro		21.475	11.056		-29.337	-17	1.057	4.234
Japanischer Yen					815			815
Mexikanischer Peso		167					37	204
Polnischer Zloty							14	14
Russischer Rubel		51					20	71
US-Dollar		27.062	4.745	718	38.383	31	743	71.682
Gesamt	USD	54.974	\$ 18.762	\$ 718	\$ 711	\$ -	\$ 2.188	\$ 77.353
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]								
Britisches Pfund	€	6.855	€ 332	€ -	€ -8.180	€ -	€ 833	€ -160
Euro		21.219	4.362		8.100		3.904	37.585
US-Dollar				2	22		-1	23
Gesamt	€	28.074	€ 4.694	€ 2	€ -58	€ -	€ 4.736	€ 37.448
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	\$	129.453	\$ 3.205	\$ 6.311	\$ 212.034
Brasilianischer Real		71.683			353.355	-71.375	524	354.187
Britisches Pfund			16.247		359.157	-6.434	10.238	379.208
Kanadischer Dollar					57.700		4.387	62.087
Chinesischer Renminbi		145.773			-418.925		2.033	-271.119
Kolumbianischer Peso					47.481			47.481
Ägyptisches Pfund		5.128					-10	5.118
Euro		13.327	76.463	14.535	138.1169	56.396	680	1.542.570
Indische Rupie		174.083			-167.733		4.598	10.948
Indonesische Rupiah		380.772			-198.637		8.385	190.520
Japanischer Yen					-277.380		4.834	-272.546
Malaysischer Ringgit					47.030			47.030
Mexikanischer Peso		378.593			-308.946		11.394	81.041
Neuseeländischer Dollar					1.450			1.450
Norwegische Krone					13.047		34	13.081
Polnischer Zloty					1.605			1.605
Russischer Rubel		183.535			-26.567	-87.606	17.422	86.784
Singapur-Dollar					70.491		194	70.685
Südafrikanischer Rand					6.840			6.840
Südkoreanischer Won					75.532			75.532
Schwedische Krone					3.531		15	3.546
Schweizer Franke					67.796		64	67.860
Taiwan-Dollar					-74.813			-74.813
US-Dollar		1.485.150	657.162	150.896	-1.128.786	-30.071	408.354	1542.705
Gesamt	USD	2.911.109	\$ 749.872	\$ 165.431	\$ 13.850	\$ -135.885	\$ 479.457	\$ 4.183.834

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]								
Argentinischer Peso	–	\$ –	\$ –	\$ –	–	\$ –	\$ 2	\$ 2
Australischer Dollar	–	–	–	–	103.709	-43	236	103.902
Brasilianischer Real	1.313	92	–	-1.863	-350	225	-583	
Britisches Pfund	3.126	1.196	–	178.307	–	688	183.317	
Kanadischer Dollar	326	–	–	6.088	–	77	6.491	
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.470	–	–	-1.470	
Euro	1.010	5.709	2.845	57361	210	-59	67.076	
Indonesische Rupiah	6.560	–	–	-6.692	–	576	444	
Japanischer Yen	–	266	–	3.339	–	1	3.606	
Mexikanischer Peso	1.214	–	–	1.523	-182	468	3.023	
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	2.373	–	10	2.383	
Norwegische Krone	–	–	–	7.697	–	–	7.697	
Russischer Rubel	1.971	–	–	1.404	–	286	3.661	
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	3	3	
Schweizer Franke	–	–	–	48	–	–	48	
Türkische Lira	–	–	–	–	–	4	4	
US-Dollar	226.701	94.697	11.177	-353.719	-1.260	14.699	-7.705	
Gesamt	USD 242.221	\$ 101.960	\$ 14.022	\$ -1.895	\$ -1.625	\$ 17.216	\$ 371.899	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]								
Britisches Pfund	USD	–	\$ –	\$ –	12.895	\$ –	\$ –	\$ 12.895
Euro	–	–	–	–	173.499	–	–	173.499
Japanischer Yen	–	–	–	–	53.383	–	–	53.383
Schweizer Franke	–	–	–	–	1.426	–	–	1.426
US-Dollar	161.497	856.860	36.257	-244.513	400	6237	816738	
Gesamt	USD 161.497	\$ 856.860	\$ 36.257	\$ -3.310	\$ 400	\$ 6.237	\$ 1.057.941	
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]								
Euro	–	\$ –	\$ –	\$ –	718	\$ –	\$ –	\$ 718
US-Dollar	1.149.672	114744	18.650	-732	2.270	-138.042	1.146.562	
Gesamt	USD 1.149.672	\$ 114.744	\$ 18.650	\$ -14	\$ 2.270	\$ -138.042	\$ 1.147.280	
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]								
Australischer Dollar	£	–	£ –	£ –	-105	£ –	£ 124	£ 19
Britisches Pfund	54.931	12121	–	–	3.756	2	2.802	73.612
Euro	538	317	–	–	-1.003	22	110	-16
US-Dollar	1.908	325	–	–	-2.675	25	435	18
Gesamt	£ 57.377	£ 12.763	£ –	£ –	-27	£ 49	£ 3.471	£ 73.633
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]								
Brasilianischer Real	USD	–	\$ –	\$ –	280	\$ –	\$ –	\$ 280
Britisches Pfund	443	–	–	–	153.633	–	12	154.088
Euro	–	–	–	–	2.444	–	213	2.657
Mexikanischer Peso	880	–	–	–	587	–	89	1.556
Russischer Rubel	88	–	–	–	–	–	8	96
US-Dollar	127.739	33.093	11.779	-158.540	44	2.377	16.492	
Gesamt	USD 129.150	\$ 33.093	\$ 11.779	\$ -1.596	\$ 44	\$ 2.699	\$ 175.169	
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]								
Australischer Dollar	USD	–	\$ –	\$ –	611	\$ -17	\$ 34	\$ 628
Brasilianischer Real	258	–	–	–	280	–	19	557
Britisches Pfund	–	–	–	–	327	–	–	327
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	1.278	–	12	1.290
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	-1.218	–	–	-1.218
Euro	–	–	–	–	-319	12	186	-121
Indonesische Rupiah	272	–	–	–	214	–	18	504
Japanischer Yen	–	–	–	–	795	–	–	795
Mexikanischer Peso	1.211	–	–	–	-290	–	158	1.079
Russischer Rubel	184	–	–	–	209	–	18	411
US-Dollar	14.184	3.739	1.216	-1.956	-28	551	17.706	
Gesamt	USD 16.109	\$ 3.739	\$ 1.216	\$ -69	\$ -33	\$ 996	\$ 21.958	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)							
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]														
Brasilianischer Real	USD	–	\$	–	\$	2.622	\$	–	\$	–	\$	2.622		
Britisches Pfund		402		257		–643		–		22		38		
Euro		2.366		1.450		–3.862		12		63		29		
US-Dollar		3.634		1.262		64		2.127		9		81		
Gesamt	USD	6.402	\$	2.969	\$	64	\$	244	\$	21	\$	166	\$	9.866
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund														
Australischer Dollar	USD	17.565	\$	–	\$	–	\$	–549	\$	–	\$	144	\$	17.160
Brasilianischer Real		9.592		–		–		–		–72		–		9.520
Britisches Pfund		11.455		–		–		30.138		–		99		41.692
Kanadischer Dollar		–		–		–		–1.380		–		–		–1.380
Chilenischer Peso		–		–		–		18.353		–		–		18.353
Chinesischer Renminbi		–		–		–		–630		–		–		–630
Kolumbianischer Peso		8.926		–		–		–8.930		–	456	–		452
Dänische Krone		–		–		–		–289		–	–	–		–289
Euro		10.756		–		–		49.382		–	44	–		60.182
Ungarischer Forint		–		–		–		7.039		–	–	–		7.039
Israelischer Schekel		–		–		–		–301		–	–1	–		–302
Japanischer Yen		–		–		–		10.157		–	–	–		10.157
Malaysischer Ringgit		9.125		–		–		–		–	137	–		9.262
Mexikanischer Peso		30.602		–		–		–22.426		–	472	–		8.648
Neuseeländischer Dollar		8.843		–		–		4.400		–	151	–		13.394
Norwegische Krone		9.268		–		–		4.840		–	141	–		14.249
Peruanischer Nuevo Sol		–		–		–		4.961		–	–	–		4.961
Polnischer Zloty		12.911		–		–		5.227		–	898	–		19.036
Russischer Rubel		4.085		–		–		–3.165		–	39	–		959
Singapur-Dollar		–		–		–		–301		–	–	–		–301
Südafrikanischer Rand		11.147		–		–		–11.098		–	16	–		65
Südkoreanischer Won		11.689		–		–		–11.448		–	59	–		300
Schwedische Krone		–		–		–		9.610		–	–	–		9.610
Thailändischer Baht		–		–		–		2.060		–	–	–		2.060
US-Dollar		18.460		36.549		4.135		–85.876		–	–1.830	–		–28.562
Gesamt	USD	174.424	\$	36.549	\$	4.135	\$	–226	\$	–	\$	753	\$	215.635
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	\$	568.312	\$	–	\$	–	\$	568.312
Brasilianischer Real		38.563		–		–		8.855		–	568	–		47.986
Britisches Pfund		14.331		–		–		–23.217		–	41	–		–8.845
Chilenischer Peso		–		–		–		67.418		–	–	–		67.418
Chinesischer Renminbi		23.798		–		–		–62.023		–	392	–		–37.833
Kolumbianischer Peso		23.795		–		–		–24.512		–	935	–		218
Euro		–		5.163		–		221.400		–4.865	78	–		221.776
Indonesische Rupiah		45.736		–		–		–45.993		–	983	–		726
Japanischer Yen		–		–		–		37.820		–	–	–		37.820
Mexikanischer Peso		46.956		–		–		–46.852		–	863	–		967
Neuseeländischer Dollar		–		–		–		46.313		–	–	–		46.313
Norwegische Krone		–		–		–		23.306		–	–	–		23.306
Peruanischer Nuevo Sol		–		–		–		39.544		–	–	–		39.544
Polnischer Zloty		–		–		–		35.801		–	319	–		36.120
Russischer Rubel		–		–		–		21.839		–	–	–		21.839
Singapur-Dollar		–		–		–		–45.623		–	–	–		–45.623
Südafrikanischer Rand		29.793		–		–		–30.262		–	–5	–		–474
Südkoreanischer Won		60.610		–		–		–59.420		–	188	–		1.378
Schwedische Krone		–		–		–		72.256		–	–	–		72.256
Schweizer Franke		–		–		–		–152.009		–	–	–		–152.009
Thailändischer Baht		–		–		–		39.208		–	–	–		39.208
US-Dollar		44.161		395.100		752		–692.400		1.272	23.430	–		–227.685
Gesamt	USD	327.743	\$	400.263	\$	752	\$	–239	\$	–3.593	\$	27.792	\$	752.718
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]														
Brasilianischer Real	USD	241	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	3	\$	244
Britisches Pfund		–		–		–		107		–	–	–		107
Kanadischer Dollar		–		–		–		11.201		–	–	–		11.201
Euro		102		–		–		–141		86	17	–		64
Schwedische Krone		–		–		–		–1		–	–	–		–1
Schweizer Franken		–		–		–		–4		–	–1	–		–5
US-Dollar		10.354		181		538		–11.132		–1	40	–		–20
Gesamt	USD	10.697	\$	181	\$	538	\$	30	\$	85	\$	59	\$	11.590

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund								
Australischer Dollar	USD 20.980	\$ –	\$ –	\$ –	-294	\$ –	\$ 165	\$ 20.851
Brasilianischer Real	12.658	–	–	–	-1.465	–	187	11.380
Britisches Pfund	12.420	–	–	–	-8.833	–	3	3.590
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	-374	–	–	-374
Chilenischer Peso	–	–	–	–	22.542	–	–	22.542
Chinesischer Renminbi	7.876	–	–	–	-7.687	–	129	318
Kolumbianischer Peso	8.034	–	–	–	-8.097	–	293	230
Dänische Krone	–	–	–	–	-78	–	–	-78
Euro	11.700	54	–	–	18.864	–	–	30.618
Ungarischer Forint	–	–	–	–	8.458	–	–	8.458
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	–	10	10
Israelischer Schekel	–	–	–	–	-82	–	–	-82
Japanischer Yen	–	–	–	–	20.980	–	–	20.980
Malaysischer Ringgit	10.886	–	–	–	–	–	174	11.060
Mexikanischer Peso	22.203	–	–	–	-11.907	–	408	10.704
Neuseeländischer Dollar	9.811	–	–	–	25.242	–	168	35.221
Norwegische Krone	10.086	–	–	–	7.392	–	155	17.633
Polnischer Zloty	21.393	–	–	–	775	–	1.103	23.271
Russischer Rubel	404	–	–	–	3.137	–	21	3.562
Singapur-Dollar	–	–	–	–	-82	–	–	-82
Südafrikanischer Rand	10.099	–	–	–	-10.100	–	-1	-2
Südkoreanischer Won	17.525	–	–	–	-16.984	–	92	633
Schwedische Krone	–	–	–	–	11.724	–	–	11.724
Thailändischer Baht	–	–	–	–	2.504	–	–	2.504
US-Dollar	20.930	42.236	3.333	–	-56.855	–	81	9725
Gesamt	USD 197.005	\$ 42.290	\$ 3.333	\$ –	-1.220	\$ –	\$ 2.988	\$ 244.396
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund								
Australischer Dollar	USD –	\$ –	\$ –	\$ –	56.572	\$ –	\$ –	\$ 56.572
Brasilianischer Real	52.270	–	–	–	-227	–	735	52.778
Britisches Pfund	–	1.443	–	–	56.126	–	16	57.585
Chilenischer Peso	–	–	–	–	81.824	–	–	81.824
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	1.177	–	–	1.177
Euro	2.673	–	–	–	501.635	11.485	1582	517.375
Mexikanischer Peso	14.838	–	–	–	-13.664	–	236	1.410
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	–	49.652	–	–	49.652
Russischer Rubel	1.285	–	–	–	-1.356	–	9	-62
Singapur-Dollar	–	–	–	–	53.926	–	-818	53.108
Schwedische Krone	–	–	–	–	3.370	–	3	3.373
Schweizer Franke	7.999	–	–	–	-1.496	–	24	6.527
Thailändischer Baht	–	–	–	–	63.944	–	–	63.944
US-Dollar	882.292	518.584	40.689	–	-859.558	9.956	70.847	662810
Gesamt	USD 961.357	\$ 520.027	\$ 40.689	\$ –	-8.075	\$ 21.441	\$ 72.634	\$ 1.608.073
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^								
Brasilianischer Real	USD –	\$ –	\$ –	\$ –	1.055	\$ –	\$ –	\$ 1.055
Chilenischer Peso	–	–	–	–	1.025	–	–	1.025
Chinesischer Renminbi	1.388	–	–	–	-1.310	–	23	101
Tschechische Krone	–	–	–	–	495	–	–	495
Euro	–	1.923	–	–	-1.214	-13	1	697
Japanischer Yen	–	–	–	–	1.047	–	–	1.047
Schwedische Krone	–	–	–	–	486	–	–	486
Thailändischer Baht	–	–	–	–	1.549	–	–	1.549
US-Dollar	15.347	31.237	1.958	–	-3.199	172	416	45.931
Gesamt	USD 16.735	\$ 33.160	\$ 1.958	\$ –	-66	\$ 159	\$ 440	\$ 52.386
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^								
Brasilianischer Real	USD 204	\$ –	\$ –	\$ –	–	\$ –	\$ 3	\$ 207
Britisches Pfund	–	–	–	–	-50	–	–	-50
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	-70	–	–	-70
Euro	223	–	–	–	9.709	74	14	10.020
US-Dollar	8.856	–	882	–	-9.785	-6	109	56
Gesamt	USD 9.283	\$ –	\$ 882	\$ –	-196	\$ 68	\$ 126	\$ 10.163

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)							
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]															
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	113.113	–	\$	113.113						
Brasilianischer Real		10.797	–	–	–	–	156	–	10.953						
Britisches Pfund		–	–	–	7	–	–	–	7						
Kanadischer Dollar		–	–	–	7.251	–	–	–	7.251						
Chilenischer Peso		–	–	–	10.831	–	–	–	10.831						
Kolumbianischer Peso		3.350	–	–	-3.448	–	171	–	73						
Tschechische Krone		5.060	–	–	-4.961	–	85	–	184						
Euro		–	–	–	3.259	248	1	–	3.508						
Japanischer Yen		–	–	–	9.178	–	–	–	9.178						
Malaysischer Ringgit		3.901	–	–	–	–	62	–	3.963						
Mexikanischer Peso		17.927	–	–	-1.173	–	328	–	17.082						
Neuseeländischer Dollar		–	–	–	3.319	–	–	–	3.319						
Polnischer Zloty		10.076	–	–	–	–	183	–	10.259						
Russischer Rubel		1.017	–	–	7.824	–	53	–	8.894						
Singapur-Dollar		–	–	–	4.099	–	–	–	4.099						
Südafrikanischer Rand		9.841	–	–	-1.043	–	-1	–	8.797						
Südkoreanischer Won		7.216	–	–	-1.771	–	39	–	5.484						
Schwedische Krone		–	–	–	10.231	–	–	–	10.231						
Thailändischer Baht		–	–	–	3.388	–	–	–	3.388						
US-Dollar		3.123	24.340	4.248	-161.140	-523	3.569	–	-126.383						
Gesamt	USD	72.308	\$	24.340	\$	-1.036	\$	-275	\$	4.646	\$	104.231			
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]															
Euro		–	\$	–	\$	1.431	–	\$	–	\$	1.431				
US-Dollar		–	–	–	2.236	-1.459	–	–	-31	–	746				
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	2.236	–	\$	-28	\$	-31	\$	2.177		
FTGF ClearBridge Value Fund															
Kanadischer Dollar		–	\$	–	\$	–	–	\$	219	\$	219				
Euro		–	–	–	27.459	31.036	–	–	-226	–	58.269				
Japanischer Yen		–	–	–	8.397	–	–	–	–	–	8.397				
Singapur-Dollar		–	–	–	–	2.329	–	–	1	–	2.330				
US-Dollar		–	–	–	845.932	-33.992	–	–	11.083	–	823.023				
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	881.788	–	\$	-627	\$	–	\$	11.077	\$	892.238
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund															
Euro		–	\$	–	\$	–	–	\$	–	\$	1				
US-Dollar		–	–	–	207.470	-1	–	–	6.010	–	213.479				
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	207.470	–	\$	–	\$	–	\$	6.010	\$	213.480
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund															
Brasilianischer Real	USD	–	\$	–	\$	–	–	\$	–	\$	54.603				
Britisches Pfund		–	–	–	–	-84	–	–	-25	–	-109				
Euro		–	–	–	–	36.993	–	–	604	–	37.597				
US-Dollar		–	–	–	1.756.332	-88.618	–	–	12.890	–	1.680.604				
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	1.756.332	–	\$	2.894	\$	–	\$	13.469	\$	1.772.695
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund															
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	–	–	\$	–	\$	5.822				
Britisches Pfund		–	–	–	–	2.236	–	–	87	–	2.323				
Chinesischer Renminbi		–	–	–	–	1.334	–	–	–	–	1.334				
Euro		–	–	–	–	928	–	–	58	–	986				
Polnischer Zloty		–	–	–	–	1.137	–	–	–	–	1.137				
Singapur-Dollar		–	–	–	–	2.292	–	–	–	–	2.292				
Schwedische Krone		–	–	–	–	22	–	–	–	–	22				
Schweizer Franke		–	–	–	–	60	–	–	–	–	60				
US-Dollar		–	–	–	536.471	-13.839	–	–	1.551	–	524.183				
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	536.471	–	\$	-10	\$	–	\$	1.698	\$	538.159

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	USD	–	–	–	1.154	–	1.154
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	9	9
Chinesischer Renminbi	–	–	–	122	–	–	122
Euro	–	–	–	1.673	–	–	1.673
Singapur-Dollar	–	–	–	440	–	–	440
US-Dollar	836	–	41.374	-3.407	–	1.078	39.881
Gesamt	USD	836	–	41.374	–18	1.087	43.279
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]							
Britisches Pfund	USD	–	–	–	80.105	-801	79.304
Euro	–	–	–	–	61.158	-304	60.854
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	36	36
US-Dollar	–	–	1.618.990	-143.217	–	-16.652	1.459.121
Gesamt	USD	–	–	1.618.990	-1.954	-17.721	1.599.315
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]							
Australischer Dollar	USD	–	–	73	–	–	73
Britisches Pfund	–	–	–	362	–	–	362
Kanadischer Dollar	–	–	–	491	–	1	492
Euro	–	–	–	1.848	–	–	1.848
Hongkong-Dollar	–	–	–	242	–	–	242
Japanischer Yen	–	–	–	467	–	–	467
Südkoreanischer Won	–	–	–	112	–	1	113
Schwedische Krone	–	–	–	342	–	–	342
Schweizer Franke	–	–	–	469	–	–	469
US-Dollar	–	–	–	9.886	–	1.724	11.610
Gesamt	USD	–	–	14.292	–	1.726	16.018
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]							
Australischer Dollar	€	–	–	12.746	3.869	-2	16.613
Brasilianischer Real	–	–	–	–	5.242	–	5.242
Britisches Pfund	–	–	–	52.025	13.891	256	66.172
Kanadischer Dollar	–	–	–	57.019	43.209	344	100.572
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	7.466	–	7.466
Dänische Krone	–	–	–	–	–	40	40
Euro	–	–	–	181.973	-128.367	18.075	71.681
Japanischer Yen	–	–	–	20.475	-2.755	-244	17.476
Singapur-Dollar	–	–	–	–	4.243	–	4.243
US-Dollar	–	–	–	324.060	55.959	1.900	381.919
Gesamt	€	–	–	648.298	2.757	20.369	671.424
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]							
Brasilianischer Real	USD	–	–	434	–	–	434
Chinesischer Renminbi	–	–	–	52	–	–	52
Euro	–	–	–	–	1.506	–	1.506
Hongkong-Dollar	–	–	–	675	–	–	675
Indische Rupie	–	–	–	525	–	–	525
Indonesische Rupiah	–	–	–	115	–	–	115
Malaysischer Ringgit	–	–	–	124	–	–	124
Mexikanischer Peso	–	–	–	496	–	1	497
Philippinischer Peso	–	–	–	188	–	–	188
Thailändischer Baht	–	–	–	28	–	–	28
US-Dollar	–	–	–	30	-1.536	27	-1.479
Gesamt	USD	–	–	2.667	-30	28	2.665
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Australischer Dollar	USD	–	–	16.494	5.446	185	22.125
Brasilianischer Real	–	–	–	5.712	–	–	5.712
Britisches Pfund	–	–	–	19.993	292	132	20.417
Kanadischer Dollar	–	–	–	20.220	–	127	20.347
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	309	–	309
Euro	–	–	–	42.484	4.673	78	47.235
Mexikanischer Peso	–	–	–	7.880	–	–	7.880
Singapur-Dollar	–	–	–	–	27.455	-218	27.237
US-Dollar	–	–	–	51.350	-38.425	9.207	22.132
Gesamt	USD	–	–	164.133	-250	9.511	173.394

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	\$	7.254	\$	-4	7.250
Brasilianischer Real	-	-	-	-	16.354	-	-	16.354
Britisches Pfund	-	-	-	-	1.252	-	477	1.729
Kanadischer Dollar	-	-	6.555	-	-	-	-2.913	3.642
Chinesischer Renminbi	-	-	-	2.406	-	-	-	2.406
Euro	-	-	-	39.523	-	12.046	-	51.569
Polnischer Zloty	-	-	-	5.274	-	-	-	5.274
Singapur-Dollar	-	-	-	26.304	-	-	51	26.355
Schwedische Krone	-	-	-	88	-	-	-1	87
US-Dollar	-	-	926.975	-98.778	-	-26.654	-	801.543
Gesamt	USD	\$	\$	933.530	\$	\$	\$	916.209
FTGF Royce US Smaller Companies Fund								
Kanadischer Dollar	-	\$	\$	2.110	\$	\$	-1	2.109
Euro	-	-	-	-	174	-	-	174
Schwedische Krone	-	-	-	-	1	-	-	1
US-Dollar	-	-	86.350	-179	-	-520	-	85.651
Gesamt	USD	\$	\$	88.460	\$	\$	\$	87.935
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	315	\$	\$	2	317
Brasilianischer Real	-	-	-	50	-	-	-	50
Britisches Pfund	-	-	499	-	-	-	-	499
Kanadischer Dollar	-	-	33	-	-	-	-	33
Euro	-	-	389	-	-	-	-	389
Japanischer Yen	-	-	513	-	-	-	-	513
Polnischer Zloty	-	-	62	-	-	-	-	62
Schwedische Krone	-	-	136	-	-	-	-	136
Schweizer Franke	-	-	89	-	-	-	-	89
US-Dollar	-	-	2.464	-	-	-18	-	2.446
Gesamt	USD	\$	\$	4.550	\$	\$	\$	4.534
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^								
Australischer Dollar	€	€	€	€	1.396	€	€	1.396
Britisches Pfund	-	-	7.898	-	-	28	-	7.926
Chinesischer Renminbi	-	-	-	-	156	-	-	156
Dänische Krone	-	-	1.379	-	-	33	-	1.412
Euro	-	-	10.946	-7.520	-	327	-	3.753
Norwegische Krone	-	-	674	-	-	1	-	675
Polnischer Zloty	-	-	-	469	-	-	-	469
Russischer Rubel	-	-	34	-	-	-	-	34
Singapur-Dollar	-	-	-	223	-	-50	-	173
Schwedische Krone	-	-	1.606	-	-	-	-	1.606
Schweizer Franke	-	-	5.297	-	-	-	-	5.297
US-Dollar	-	-	-	5.415	-	25	-	5.440
Gesamt	€	€	€	27.834	€	€	€	28.337
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund								
Australischer Dollar	USD	\$	\$	1.981	\$	\$	19	4.146
Chinesischer Renminbi	-	-	-	-	227	-	-	227
Hongkong-Dollar	-	-	10.706	-	-	-	-	10.706
Indische Rupie	-	-	1.964	-	-	-	-	1.964
Indonesische Rupiah	-	-	748	-	-	56	-	804
Malaysischer Ringgit	-	-	794	-	-	-	-	794
Pakistanische Rupie	-	-	185	-	-	-	-	185
Philippinischer Peso	-	-	362	-	-	54	-	416
Polnischer Zloty	-	-	-	2.324	-	-	-	2.324
Singapur-Dollar	-	-	273	34	-	-	-	307
Südkoreanischer Won	-	-	3.371	-	-	57	-	3.428
Taiwan-Dollar	-	-	4.876	-	-	1	-	4.877
Thailändischer Baht	-	-	302	-	-	-	-	302
US-Dollar	-	-	335	-4.836	-	-96	-	-4.597
Gesamt	USD	\$	\$	25.897	\$	\$	\$	25.883

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt						
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	283	\$	456	\$	–	\$	3	\$	742
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	432	–	–	–	–	–	6	–	438
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	152	–	–	–	–	–	1	–	153
Euro	–	–	–	–	–	1.098	–	–	–	–	–	11	–	1.109
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	616	–	–	–	–	–	1	–	617
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	1.014	–	–	–	–	–	–	–	1.014
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	96	–	–	–	–	–	–	–	96
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	–	–	53	–	–	–	–	–	53
Schweizer Franke	–	–	–	–	–	412	–	–	–	–	–	–	–	412
Taiwan-Dollar	–	–	–	–	–	937	–	–	–	–	–	1	–	938
Türkische Lira	–	–	–	–	–	113	–	–	–	–	–	12	–	125
US-Dollar	–	–	–	–	–	7.219	–	-503	–	–	–	130	–	6.846
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	12.372	\$	6	\$	–	\$	165	\$	12.543
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]														
Hongkong-Dollar	–	\$	–	\$	6.614	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	6.614
Indische Rupie	–	–	–	–	1.901	–	–	–	–	–	28	–	–	1.929
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	362	–	–	–	–	–	–	–	–	362
Singapur-Dollar	–	–	–	–	1.937	–	–	–	–	–	–	–	–	1.937
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	2.174	–	–	–	–	–	24	–	–	2.198
Taiwan-Dollar	–	–	–	–	1.879	–	–	–	–	–	–	–	–	1.879
US-Dollar	–	–	–	–	596	–	–	–	–	–	603	–	–	1.199
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	15.463	\$	–	\$	–	\$	655	\$	16.118
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	5.028	\$	-377	\$	–	\$	377	\$	5.028
Britisches Pfund	–	–	–	–	889	–	2460	–	–	–	–	–	–	3.349
Dänische Krone	–	–	–	–	5.093	–	–	–	–	–	17	–	–	5110
Euro	–	–	–	–	41.268	–	94.884	–	–	–	1.786	–	–	137.938
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	14.747	–	-1.083	–	–	–	1.083	–	–	14.747
Schwedische Krone	–	–	–	–	18.215	–	-926	–	–	–	926	–	–	18.215
Taiwan-Dollar	–	–	–	–	10.526	–	–	–	–	–	789	–	–	11.315
US-Dollar	–	–	–	–	74.692	–	-96.875	–	–	–	-4.138	–	–	-26.321
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	170.458	\$	-1.917	\$	–	\$	840	\$	169.381
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund														
Australischer Dollar	USD	–	\$	–	\$	9.168	\$	681	\$	–	\$	143	\$	9.992
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	–	1	–	–	–	–	–	–	1
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	6.848	–	–	–	–	–	-1	–	–	6.847
Indische Rupie	–	–	–	–	3.665	–	–	–	–	–	-1	–	–	3.664
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	708	–	–	–	–	–	–	–	–	708
Neuseeländischer Dollar	–	–	–	–	1.154	–	–	–	–	–	1	–	–	1.155
Philippinischer Peso	–	–	–	–	1.005	–	–	–	–	–	–	–	–	1.005
Singapur-Dollar	–	–	–	–	3.744	–	1022	–	–	–	16	–	–	4782
Thailändischer Baht	–	–	–	–	1.321	–	–	–	–	–	22	–	–	1.343
US-Dollar	–	–	–	–	–	–	-1.703	–	–	–	140	–	–	-1.563
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	27.613	\$	1	\$	–	\$	320	\$	27.934
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]														
Brasilianischer Real	USD	–	\$	–	\$	2.427	\$	–	\$	–	\$	3	\$	2.430
Britisches Pfund	–	–	–	–	906	–	–	–	–	–	–	–	–	906
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	2.232	–	–	–	–	–	-1	–	–	2.231
Euro	–	–	–	–	664	–	–	–	–	–	–	–	–	664
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	9.993	–	–	–	–	–	–	–	–	9.993
Ungarischer Forint	–	–	–	–	998	–	–	–	–	–	–	–	–	998
Indische Rupie	–	–	–	–	8.569	–	–	–	–	–	-148	–	–	8.421
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	1.424	–	–	–	–	–	–	–	–	1.424
Mexikanischer Peso	–	–	–	–	368	–	–	–	–	–	–	–	–	368
Philippinischer Peso	–	–	–	–	203	–	–	–	–	–	-1	–	–	202
Saudi-Rial	–	–	–	–	911	–	–	–	–	–	–	–	–	911
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	8.972	–	–	–	–	–	51	–	–	9023
Taiwan-Dollar	–	–	–	–	6.329	–	–	–	–	–	–	–	–	6.329
US-Dollar	–	–	–	–	3.643	–	–	–	–	–	295	–	–	3.938
Gesamt	USD	–	\$	–	\$	47.639	\$	–	\$	–	\$	199	\$	47.838

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisenterminkontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Nettovermögenswerte/verbindlichkeiten (in Tsd.)	Sonstige Nettoinventarwert (in Tsd.)	Gesamt-Nettoinventarwert (in Tsd.)
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]								
Brasilianischer Real	€	€	–	€	3.169	€	–	€ 3.169
Britisches Pfund	–	–	11.052	–	–	–	–	11.052
Dänische Krone	–	–	13.417	–	–	17	–	13.434
Euro	–	–	203.394	-3.034	–	808	–	201.168
Schwedische Krone	–	–	42.376	–	–	1	–	42.377
Schweizer Franke	–	–	11.864	–	–	–	–	11.864
US-Dollar	–	–	20.448	77	–	1	–	20.526
Gesamt	€	€	€	€	212	€	€ 827	€ 303.590

In bestimmten Fonds gibt es auch Anteilklassen, die in Fremdwährungen aufgelegt wurden. Bestimmte Fonds (wie in der entsprechenden Ergänzung zum Prospekt angegeben) können Devisentermingeschäfte (lieferbare und nicht lieferbare Kontrakte) abschließen, um sich gegen Wechselkursrisiken abzusichern, das Engagement in einer Währung zu erhöhen oder das Risiko von Währungsschwankungen von einer Währung zu einer anderen zu verlagern oder die Rendite zu steigern. Jeder Rentenfonds kann außerdem Optionen auf lieferbare und nicht lieferbare Devisenterminkontrakte abschließen, die dem Fonds im Austausch gegen eine Prämie die Möglichkeit geben, einen solchen Kontrakt vor einem bestimmten Datum zu schließen, ohne dazu verpflichtet zu sein.

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 2023 und am 28. Februar 2022 wurde für alle Fonds ein Auszug der zugrunde liegenden Positionen erstellt. Die Wechselkurse wurden um +/- 5 % erhöht/gesenkt (aufgrund der Beschaffenheit der Märkte, in denen die Fonds anlegen, wurde eine 5 %-ige Erhöhung/Senkung vorgenommen); es wurde eine Schätzung der entsprechenden Auswirkung auf den Gesamt Nettoinventarwert vorgenommen. Des Weiteren wird angenommen, dass auch alle anderen Marktparameter unverändert bleiben.

Fonds	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse* (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		28. Februar 2023		28. Februar 2022	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Australischer Dollar	3.257	-2.947	4.916	-4.448
	Britisches Pfund	k. A.	k. A.	2826	-2.557
	Schweizer Franke	2.873	-2.599	k. A.	k. A.
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	k. A.	k. A.	454	-411
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	Euro	k. A.	k. A.	433	-392
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Chinesischer Renminbi	k. A.	k. A.	6827	-6.177
	Indonesische Rupiah	3.357	-3.037	3.741	-3.385
	Malaysischer Ringgit	2.666	-2.412	2.880	-2.606
	Singapur-Dollar	2.489	-2.252	3.327	-3.010
	Südkoreanischer Won	4.113	-3.722	4.002	-3.621
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Britisches Pfund	15.035	-13.603	13.955	-12.626
	Euro	5.320	-4.813	2.850	-2.579
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Kanadischer Dollar	4.723	-4.273	5.383	-4.871
	Euro	963	-871	2.510	-2.271
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Euro	40.788	-36.903	81.188	-73.456
	Japanischer Yen	-11.299	10.222	k. A.	k. A.
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Australischer Dollar	k. A.	k. A.	5469	-4.948
	Britisches Pfund	9.295	-8.410	9.648	-8.729
	Euro	2.612	-2.363	3.530	-3.194
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Euro	k. A.	k. A.	9132	-8.262
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Britisches Pfund	4.119	-3.726	8.110	-7.338
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Brasilianischer Real	133	121	138	-125
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Britisches Pfund	1.272	-1.150	2.194	-1.985
	Euro	2.399	-2.171	3.167	-2.866
	Japanischer Yen	1.332	-1.205	k. A.	k. A.
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Australischer Dollar	7.890	-7.138	29.911	-27.062
	Euro	8.261	-7.474	11.672	-10.561
	US-Dollar	-3.417	3.092	-8.000	7.239
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Kanadischer Dollar	520	-471	590	-533
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Euro	1.789	-1.619	1.611	-1.458
	Japanischer Yen	2.160	-1.954	k. A.	k. A.
	US-Dollar	k. A.	k. A.	1854	-1.677
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Euro	22.697	-20.535	27.230	-24.637
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Euro	445	-403	527	-477
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Australischer Dollar	3.760	-3.402	5953	-5.386
	Brasilianischer Real	408	-369	576	-522
	Chilenischer Peso	k. A.	k. A.	570	-516
	Canadian Dollar	388	-351	k. A.	k. A.
	Japanese Yen	762	-689	k. A.	k. A.
	Mexikanischer Peso	748	-677	899	-813
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Euro	70	-64	75	-68
FTGF ClearBridge Value Fund	Euro	5.050	-4.569	k. A.	k. A.
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Euro	71	-64	97	-88
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Britisches Pfund	6.438	-5.825	k. A.	k. A.
	Kanadischer Dollar	7.008	-6.341	5.293	-4.789
	US-Dollar	26.565	-24.035	20.101	-18.187
Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]	Brasilianischer Real	k. A.	k. A.	23	-21
	Euro	k. A.	k. A.	79	-72
	Hongkong-Dollar	k. A.	k. A.	36	-32
	Indische Rupie	k. A.	k. A.	28	-25
	Mexikanischer Peso	k. A.	k. A.	26	-24
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Australischer Dollar	2.594	-2.347	1.164	-1.054
	Britisches Pfund	3.356	-3.037	1.075	-972
	Kanadischer Dollar	2.292	-2.073	1.071	-969
	Euro	7.073	-6.399	2.486	-2.249
	Singapur-Dollar	3.471	-3.140	1434	-1.297

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Fonds	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse* (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		28. Februar 2023		28. Februar 2022	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Britisches Pfund	30	-27	26	-24
	Japanischer Yen	26	-24	27	-24
	Singapur-Dollar	3.471	-3.140	k. A.	k. A.
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	Britisches Pfund	k. A.	k. A.	417	-377
	US-Dollar	k. A.	k. A.	286	-259
		k. A.	k. A.	279	-252
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Australischer Dollar	277	-251	218	-197
	Hongkong-Dollar	392	-355	563	-510
	Südkoreanischer Won	142	-128	180	-163
	Taiwan-Dollar	190	-172	257	-232
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	Hongkong-Dollar	89	-81	348	-315
	Indische Rupie	k. A.	k. A.	102	-92
	Singapur-Dollar	30	-27	102	-92
	Südkoreanischer Won	31	-28	116	-105
	Taiwan-Dollar	23	-21	99	-89
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	Euro	6.877	-6.222	7.260	-6.568
	Schwedische Krone	k. A.	k. A.	959	-867
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Australischer Dollar	472	-427	526	-476
	Hongkong-Dollar	368	-333	360	-326
	Indische Rupie	158	-143	193	-174
	Singapur-Dollar	165	-149	252	-228
	Hongkong-Dollar	434	-392	526	-476
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Indische Rupie	309	-279	443	-401
	Südkoreanischer Won	292	-264	475	-430
	Taiwan-Dollar	228	-206	333	-301
	Schwedische Krone	1.349	-1.221	2.230	-2.018

Eine Analyse wird angegeben, sofern der Fonds ein erhebliches Fremdwährungsengagement enthält. Als erheblich gilt ein Engagement, wenn es 10 % des Nettovermögens übersteigt. Veränderungen sämtlicher Wechselkurse werden sich direkt auf den Nettoinventarwert auswirken. Die Wechselkurse zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 sind in Erläuterung 11 angegeben. Diese Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Sensitivitätsanalyse für das Fremdwährungsrisiko 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[^] wurden bei der Berechnung des Marktrisikos mit dem VaR-Ansatz berücksichtigt (siehe Erläuterung 12.1 oben).

(c) Zinsrisiko

Eine Sensitivitätsanalyse für die Aktienfonds wurde nicht erstellt, da es sich bei der Mehrheit der Vermögenswerte der Aktienfonds um unverzinsliche Vermögenswerte handelt und das Risiko daher nicht wesentlich genug ist.

Zum 28. Februar 2023 und zum 28. Februar 2022 wurden die gesamten Barmittel der Fonds von der Verwahrstelle oder sonstigen Brokern gehalten und haben das Potenzial zur Erwirtschaftung von Zinserträgen, 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 2023 und 28. Februar 2022 wie folgt dar:

Zum 28. Februar 2023

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,10 %	0,05
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	3,91 %	17,10
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	11,46 %	6,45
Indonesische Rupiah	6,53 %	9,13
Mexikanischer Peso	8,96 %	17,37
Russischer Rubel	0,00 %	8,80
US-Dollar	4,07 %	16,48
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,65 %	9,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	4,59 %	5,01
US-Dollar	4,98 %	13,87
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,92 %	3,84
Euro	5,73 %	5,10
Indonesische Rupiah	7,30 %	5,32
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	5,29 %	6,46
Russischer Rubel	0,00 %	8,26
Südafrikanischer Rand	10,32 %	18,01
US-Dollar	5,55 %	10,34
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,47 %	5,97
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,46 %	4,27
Mexikanischer Peso	8,78 %	14,10
Britisches Pfund	6,55 %	3,51
Russischer Rubel	0,00 %	5,52
US-Dollar	6,10 %	6,18

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	3,54 %	9,88
Indische Rupie	7,62 %	5,39
Indonesische Rupiah	7,41 %	4,02
Malaysischer Ringgit	3,94 %	8,13
Philippinischer Peso	6,58 %	12,88
Singapur-Dollar	1,62 %	11,90
Südkoreanischer Won	2,15 %	7,88
Thailändischer Baht	3,18 %	15,31
US-Dollar	3,87 %	20,28
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	1,29 %	4,27
Britisches Pfund	3,12 %	3,47
US-Dollar	2,55 %	4,41
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,82 %	7,85
Kanadischer Dollar	3,15 %	12,68
Euro	2,11 %	10,77
Indonesische Rupiah	7,45 %	16,14
Japanischer Yen	0,37 %	18,27
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	4,49 %	10,37
Südafrikanischer Rand	10,32 %	18,01
Südkoreanischer Won	1,99 %	3,28
US-Dollar	3,03 %	12,58
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	1,72 %	6,04
Britisches Pfund	3,52 %	5,93
US-Dollar	5,03 %	13,42
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Australischer Dollar	3,66 %	24,07
Brasilianischer Real	11,53 %	6,58
Ägyptisches Pfund	19,19 %	1,25
Euro	6,35 %	8,93
Indische Rupie	7,41 %	4,13
Indonesische Rupiah	7,17 %	9,92
Mexikanischer Peso	9,06 %	21,28
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Russischer Rubel	0,00 %	10,55
Südafrikanischer Rand	9,68 %	14,57
US-Dollar	5,32 %	14,38
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Kanadischer Dollar	5,78 %	3,21
Euro	4,75 %	32,52
Indonesische Rupiah	6,80 %	5,57
Mexikanischer Peso	8,88 %	6,26
Britisches Pfund	6,99 %	4,12
US-Dollar	6,74 %	8,16
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
US-Dollar	6,02 %	10,84
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	4,27 %	25,94
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Euro	2,89 %	8,65
Britisches Pfund	4,00 %	9,73
US-Dollar	4,21 %	24,53
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Euro	5,09 %	15,01
Mexikanischer Peso	9,10 %	15,73
Britisches Pfund	6,82 %	15,89
US-Dollar	4,80 %	9,16
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	12,15 %	9,85
Indonesische Rupiah	6,69 %	6,82
Mexikanischer Peso	9,03 %	19,72
Russischer Rubel	0,00 %	6,24
US-Dollar	4,33 %	16,65
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Euro	2,05 %	6,12
Britisches Pfund	2,86 %	6,35
US-Dollar	4,65 %	13,12
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2023 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
Brasilianischer Real	10,44 %	2,99
Kanadischer Dollar	2,55 %	2,26
Kolumbianischer Peso	7,95 %	5,17
Euro	1,84 %	9,47
Mexikanischer Peso	8,90 %	15,49
Neuseeländischer Dollar	4,24 %	16,51
Norwegische Krone	2,00 %	0,23
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	0,76 %	0,39
Russischer Rubel	8,30 %	3,38
Südafrikanischer Rand	9,63 %	16,25
Südkoreanischer Won	3,15 %	21,80
US-Dollar	2,60 %	23,18
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,93 %	8,54
Kolumbianischer Peso	12,00 %	20,55
Mexikanischer Peso	9,16 %	28,81
Neuseeländischer Dollar	3,92 %	28,23
Peruanischer Sol	7,00 %	9,46
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Südafrikanischer Rand	11,21 %	25,02
US-Dollar	3,98 %	16,53
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	3,00 %	8,47
US-Dollar	6,93 %	4,77
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Brasilianischer Real	11,43 %	6,24
Kanadischer Dollar	2,03 %	0,51
Kolumbianischer Peso	9,94 %	10,86
Euro	1,79 %	8,29
Malaysischer Ringgit	3,67 %	2,07
Mexikanischer Peso	9,05 %	18,22
Neuseeländischer Dollar	3,92 %	28,23
Norwegische Krone	2,00 %	0,23
Polnischer Zloty	2,57 %	9,16
Britisches Pfund	0,76 %	0,39
Russischer Rubel	0,00 %	7,12
Südafrikanischer Rand	10,77 %	21,57
Südkoreanischer Won	2,37 %	13,30
US-Dollar	4,05 %	26,32
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Australischer Dollar	2,79 %	7,80
Brasilianischer Real	11,75 %	9,41
Kolumbianischer Peso	9,86 %	8,08
Euro	2,01 %	28,20
Japanischer Yen	0,00 %	0,00
Mexikanischer Peso	8,86 %	28,40
US-Dollar	5,18 %	7,34
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Brasilianischer Real	12,15 %	9,85
Kolumbianischer Peso	13,18 %	27,68
US-Dollar	5,87 %	21,21
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Euro	5,06 %	3,59
US-Dollar	6,47 %	4,48
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,60 %	6,72
Kolumbianischer Peso	9,42 %	7,79
Tschechische Krone	2,28 %	9,32
Malaysischer Ringgit	3,67 %	2,12
Mexikanischer Peso	9,03 %	17,86
Südafrikanischer Rand	11,04 %	23,65
Südkoreanischer Won	2,37 %	13,18
US-Dollar	5,27 %	23,41
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,39 %	7,67
Kolumbianischer Peso	9,86 %	8,08
Euro	1,95 %	7,29
Japanischer Yen	0,00 %	0,00
Mexikanischer Peso	7,89 %	21,98
Britisches Pfund	5,20 %	1,22
US-Dollar	5,28 %	6,84
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,74 %	5,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	0,15 %	0,10
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Chinesischer Renminbi	3,20 %	3,76
US-Dollar	3,13 %	17,76
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	10,36 %	3,23
Indonesische Rupiah	6,45 %	10,13
Mexikanischer Peso	8,17 %	19,44
Russischer Rubel	12,36 %	8,78
US-Dollar	3,00 %	15,82
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Euro	1,39 %	10,60
Britisches Pfund	4,21 %	7,18
US-Dollar	2,98 %	12,73
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^]		
Kanadischer Dollar	5,33 %	4,21
US-Dollar	6,08 %	4,67
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,32 %	2,74
Britisches Pfund	5,48 %	8,58
Chinesischer Renminbi	3,67 %	10,40
Euro	5,47 %	6,30
Indonesische Rupiah	7,05 %	6,31
Mexikanischer Peso	7,97 %	16,81
Russischer Rubel	14,03 %	8,80
Südafrikanischer Rand	9,74 %	19,01
US-Dollar	4,93 %	10,72
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	5,94 %	7,05
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]		
Ägyptisches Pfund	14,04 %	0,64
Indische Rupie	5,86 %	0,78
Indonesische Rupiah	7,46 %	4,40
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
US-Dollar	5,35 %	14,25
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]		
US-Dollar	5,51 %	9,28
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Britisches Pfund	5,76 %	4,47
Euro	4,46 %	5,40
Indonesische Rupiah	6,94 %	0,21
Mexikanischer Peso	7,94 %	14,74
Russischer Rubel	13,40 %	6,50
US-Dollar	5,41 %	7,38
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	3,47 %	11,45
Indische Rupie	7,31 %	4,88
Indonesische Rupiah	7,33 %	4,95
Malaysischer Ringgit	3,93 %	7,58
Philippinischer Peso	4,93 %	8,33
Singapur-Dollar	2,67 %	41,56
Südkoreanischer Won	1,51 %	9,27
Thailändischer Baht	3,09 %	16,31
US-Dollar	4,22 %	42,42
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	0,69 %	4,48
Britisches Pfund	1,26 %	3,35
US-Dollar	2,19 %	5,81
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Britisches Pfund	3,82 %	16,24
Kanadischer Dollar	2,78 %	14,31
Euro	2,45 %	15,52
Indonesische Rupiah	7,36 %	17,14
Japanischer Yen	0,48 %	27,91
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
Südafrikanischer Rand	9,74 %	19,01
Südkoreanischer Won	1,92 %	4,28
US-Dollar	2,16 %	11,92

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Britisches Pfund	3,32 %	6,26
Euro	1,65 %	7,05
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	4,18 %	14,38
Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]		
Britisches Pfund	5,27 %	6,23
Euro	4,52 %	4,68
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Australischer Dollar	2,60 %	26,34
Brasilianischer Real	10,78 %	8,00
Chinesischer Renminbi	3,43 %	23,24
Ägyptisches Pfund	5,03 %	0,75
Euro	3,61 %	6,47
Indische Rupie	7,24 %	4,44
Indonesische Rupiah	7,18 %	10,15
Mexikanischer Peso	8,10 %	21,72
Russischer Rubel	13,20 %	8,04
US-Dollar	4,68 %	17,52
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,50 %	5,09
Britisches Pfund	5,69 %	4,78
Kanadischer Dollar	5,33 %	4,21
Euro	3,18 %	37,61
Indonesische Rupiah	6,99 %	5,01
Mexikanischer Peso	8,20 %	7,26
Russischer Rubel	13,18 %	5,89
US-Dollar	5,29 %	7,98
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	4,28 %	13,01
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	3,38 %	22,95
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Britisches Pfund	3,29 %	10,42
Euro	0,47 %	9,58
US-Dollar	3,19 %	16,22
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Britisches Pfund	3,69 %	6,27
Mexikanischer Peso	8,19 %	16,73
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	3,60 %	12,79
Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,67 %	6,81
Indonesische Rupiah	6,51 %	7,80
Mexikanischer Peso	8,09 %	20,72
Russischer Rubel	13,67 %	7,24
US-Dollar	3,05 %	15,96
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Britisches Pfund	2,92 %	6,54
Euro	1,40 %	6,92
US-Dollar	3,86 %	14,47
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	5,29 %	0,74
Brasilianischer Real	10,21 %	3,86
Britisches Pfund	0,28 %	9,42
Kolumbianischer Peso	7,05 %	6,17
Euro	0,00 %	9,75
Malaysischer Ringgit	3,61 %	2,53
Mexikanischer Peso	7,68 %	13,86
Neuseeländischer Dollar	4,69 %	8,21
Norwegische Krone	1,98 %	1,23
Polnischer Zloty	4,00 %	1,65
Russischer Rubel	8,89 %	4,38
Südafrikanischer Rand	9,35 %	18,74
Südkoreanischer Won	2,72 %	22,80
US-Dollar	2,06 %	27,93

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2022 – (Fortsetzung)

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,84 %	8,59
Britisches Pfund	0,80 %	28,67
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
Kolumbianischer Peso	8,38 %	17,91
Indonesische Rupiah	7,53 %	11,09
Mexikanischer Peso	8,17 %	21,87
Südafrikanischer Rand	10,47 %	26,02
Südkoreanischer Won	1,65 %	8,79
US-Dollar	4,71 %	26,32
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,47 %	4,84
Euro	3,69 %	5,88
US-Dollar	5,91 %	6,13
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	5,34 %	0,69
Brasilianischer Real	10,70 %	7,19
Britisches Pfund	0,28 %	9,42
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
Kolumbianischer Peso	6,96 %	5,19
Euro	0,00 %	9,75
Malaysischer Ringgit	3,72 %	2,01
Mexikanischer Peso	8,16 %	16,51
Neuseeländischer Dollar	4,70 %	8,15
Norwegische Krone	1,98 %	1,23
Polnischer Zloty	4,00 %	1,65
Russischer Rubel	14,56 %	8,12
Südafrikanischer Rand	10,11 %	22,58
Südkoreanischer Won	2,14 %	14,55
US-Dollar	3,79 %	27,61
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Brasilianischer Real	10,23 %	4,79
Euro	0,48 %	7,18
Mexikanischer Peso	7,55 %	21,80
Russischer Rubel	6,80 %	3,90
Schweizer Franke	0,50 %	0,41
US-Dollar	4,21 %	5,43
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Chinesischer Renminbi	3,55 %	28,56
US-Dollar	4,89 %	8,77
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,47 %	4,84
Euro	4,20 %	5,24
US-Dollar	5,95 %	6,38
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,77 %	7,71
Kolumbianischer Peso	7,05 %	6,17
Tschechische Krone	1,98 %	10,32
Malaysischer Ringgit	3,76 %	2,14
Mexikanischer Peso	8,13 %	18,91
Polnischer Zloty	2,14 %	10,16
Russischer Rubel	14,56 %	8,12
Südafrikanischer Rand	10,33 %	24,67
Südkoreanischer Won	2,14 %	14,53
US-Dollar	6,22 %	24,91

Reform der Zinssatz-Benchmarks

Weltweit wird eine grundlegende Reform der großen Zinssatz-Benchmarks durchgeführt, einschließlich des Ersatzes einiger Interbank Offered Rates (IBORs) durch alternative, nahezu risikofreie Zinssätze (die „IBOR-Reform“). Für die Fonds sind IBORs bei ihren Finanzinstrumenten relevant und diese werden im Rahmen dieser marktweiten Initiativen ersetzt oder reformiert. Einige Rechtsordnungen reformieren ihre Benchmark-Zinssätze oder streichen diese, insbesondere die London Interbank Offered Rates („LIBOR“) in mehreren Währungen. Viele dieser Reformen und Streichungen wurden zum Ende des Kalenderjahres 2021 wirksam; einige USD-LIBOR-Sätze bleiben bis Juni 2023 bestehen. Diese Zinssatzänderungen können sich auf bestehende Transaktionen und vertragliche Vereinbarungen auswirken. Das Management hat Schritte unternommen, um sich darauf vorzubereiten und die Auswirkungen veränderter Basiszinssätze zu begrenzen, und ist weiterhin um eine effiziente Steuerung der Umstellung bemüht. Es bewertet die Auswirkungen künftiger Veränderungen auf bestehende Transaktionen und vertragliche Vereinbarungen.

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

Franklin Templeton hat zusätzlich zum Ausschuss das Valuation Committee (der „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 haben während des Geschäftsjahres Derivatkontrakte abgeschlossen. Der Wert von Derivaten basiert auf bestimmten zugrunde liegenden Aktien oder Anleihen, Zinssätzen, Währungen oder Indizes. Derivate umfassen Futures, Optionen, Optionen auf Futures, Differenzkontrakte und Swaps. Derivate sind möglicherweise schwerer zu einem vorteilhaften Preis oder Zeitpunkt zu verkaufen und reagieren empfindlich auf Änderungen des zugrunde liegenden Wertpapiers, Zinssatzes, der Währung oder des Index. Daher können Derivate sehr volatil sein und zu einem Verlust für den Fonds führen. Einzelheiten zu offenen Derivatpositionen zum Ende des Geschäftsjahres finden Sie im Anlagenportfolio der jeweiligen Fonds.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat im Einklang mit FRS 102 beschlossen, die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Accounting Standards („IAS“) 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ („IAS 39“) in der zur Anwendung in der Europäischen Union übernommenen Fassung und die Offenlegungsbestimmungen der Abschnitte 11 und 12 von FRS 102 anzuwenden.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag. Steht für ein Wertpapier keine „jederzeit verfügbare Marktnotierung“ zur Verfügung, wendet die Gesellschaft „Marktwertmethoden“ an, um den Preis des Wertpapiers zu bestimmen. Generell handelt es sich beim beizulegenden Zeitwert um den Preis, mit dessen Erzielung der Fonds bei einem sofortigen Verkauf in angemessener Weise rechnen darf. Bei der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert muss der Bewertungsausschuss ausgehend von den jeweiligen Fakten und Umständen den Wert eines bestimmten Wertpapiers oder einer Gruppe von Wertpapieren in gutem Glauben bestimmen.

Umstände, unter denen keine jederzeit verfügbare Marktnotierung zur Verfügung steht, beinhalten unter anderem die Aussetzung des Handels vor der Schließung des betreffenden Marktes; Ereignisse, die unerwartet zur Schließung ganzer Märkte führen, wie beispielsweise Naturkatastrophen, Stromausfall oder ähnliche schwerwiegende Ereignisse; Feiertage ohne Handel oder das Handelsvolumen für ein bestimmtes Wertpapier.

Bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Portfoliowertpapiers kann der Bewertungsausschuss alle relevanten Methoden berücksichtigen, unter anderem eine oder sämtliche der nachfolgend aufgeführten Preisbestimmungsmethoden:

- (i) Gewinnkennzahlen
- (ii) Marktabschlag eines ähnlich frei gehandelten Wertpapiers
- (iii) Diskontierte Cashflow-Analyse
- (iv) Buchwert oder Verhältniswert
- (v) Risikoaufschlag/Renditeanalyse
- (vi) Endfälligkeitsrendite und/oder
- (vii) Fundamentale Investmentanalyse

Der Bewertungsausschuss überprüft jeden Monat die Angemessenheit und Richtigkeit der für die Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts von Wertpapieren eingesetzten Methoden. Unter anderem vergleicht er dabei die jeweiligen beizulegenden Zeitwerte mit dem letzten Marktpreis und dem nächsten verfügbaren Marktpreis, beispielsweise dem Eröffnungskurs des Folgetages.

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwerthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwerthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten zum 28. Februar 2023 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)		FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	
Stufe 1										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	–	\$	–	€	–	\$	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–		414
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		367		3.030		480		74
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		-250		-4.240		-1.069		-29
		–		117		-1.210		-589		459
Stufe 2										
Anleihen und Schuldtitel	\$	599.348	\$	138.314	\$	1.182.487	€	125.184	\$	198.461
Geldmarktinstrumente		244.848		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		1.741		–		654		4.016
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		2.534		8.816		72		775
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		-46		-4.445		-338		-4.011
		844.196		142.543		1.186.858		125.572		199.241
Stufe 3										
Anleihen und Schuldtitel	\$	–	\$	111	\$	642	€	–	\$	–
Geldmarktinstrumente		–		–		–		–		–
Eigenkapitalinstrumente		–		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte		–		–		–		–		–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten		–		–		–		–		–
		–		111		642		–		–
Anlagen insgesamt	\$	844.196	\$	142.771	\$	1.186.290	€	124.983	\$	199.700

Anhang 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 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	1	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	38	–	4.839	343
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-31	–	-373	-61	-1.047
	-31	39	-373	4.778	-704
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 121.003	\$ 52.582	\$ 429.611	\$ 515.122	\$ 135.809
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.661	133	3.862	17.040	11.217
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	103	60	162	3.920	1.025
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-151	-271	-1.130	-3.219	-2.097
	122.616	52.504	432.505	532.863	145.954
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 101	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	642	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	743	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 123.328	\$ 52.543	\$ 432.132	\$ 537.641	\$ 145.250

	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Multi- Asset Credit Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	202	26.445	277	317	353
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-34	-86.734	-926	-73	-731
	168	-60.289	-649	244	-378
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 43.206	\$ 1.888.885	\$ 263.595	\$ 521.432	\$ 1.147.183
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	559	18.550	507	17.212	1.154
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	343	177.483	1.911	8	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-166	-93.430	-3.726	-1.683	–
	43.942	1.991.488	262.287	536.969	1.148.337
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 7.808	\$ 1.339	\$ 18.407	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	2.424	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	7.808	3.763	18.407	–
Anlagen insgesamt	\$ 44.110	\$ 1.939.007	\$ 265.401	\$ 555.620	\$ 1.147.959

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 UK Investment Grade Credit Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	253	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	45	4	175	59	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-29	-103	-158	-5	–
	16	154	17	54	–
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	£ 43.921	\$ 93.939	\$ 15.938	\$ 8.541	\$ 160.235
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	1.342	30	4.095
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	27	35	910	92	3132
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-7	-478	-60	-107	-3.966
	43.941	93.496	18.130	8.556	163.496
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	£ 43.957	\$ 93.650	\$ 18.147	\$ 8.610	\$ 163.496

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	2.190	2	–	–	69
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	-3.704	-175
	2.190	2	–	-3.704	-84
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 508.142	\$ 9.964	\$ 200.639	\$ 1.068.451	\$ 43.555
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	30.565	396	4.087	85.354	2.216
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	13.024	10	1.448	4.819	403
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-23.627	-202	-4.239	-13.267	-416
	528.104	10.168	201.935	1.145.357	45.758
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 530.294	\$ 10.170	\$ 201.935	\$ 1.141.653	\$ 45.674

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Multi- Sector Impact Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Value Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	2.542	921.986
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-283	-123	-	-
	-	-283	-123	2.542	921.986
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 8.077	\$ 65.808	\$ 13.130	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	411	3.886	-	41	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	249	119	-	10
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-192	-3.482	-64	-20	-976
	8.296	66.461	13.185	21	-966
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Anlagen insgesamt	\$ 8.296	\$ 66.178	\$ 13.062	\$ 2.563	\$ 921.020

	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	180.681	1.172.787	214.039	36.033	1.629.033
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	180.681	1.172.787	214.039	36.033	1.629.033
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 557	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	286	4	1	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-1.551	-229	-56	-840
	-	-1.265	-225	502	-818
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Anlagen insgesamt	\$ 180.681	\$ 1.171.522	\$ 213.814	\$ 36.535	\$ 1.628.215

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	12.820	1.032.510	399.290	711.568	77.554
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	12.820	1.032.510	399.290	711.568	77.554
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3	–	–	32.545	1.100
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	1.921	24	150	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.058	-2.229	-1.623	-2
	3	863	-2.205	31.072	1.098
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 12.823	€ 1.033.373	\$ 397.085	\$ 742.640	\$ 78.652

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.093	–	20.882	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	4.093	–	20.882	–	–
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	180	–	1	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-90	–	–
	180	–	-89	–	–
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 4.273	€ –	\$ 20.793	\$ –	\$ –

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 Asia Long-Term Unconstrained Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	3.598	142.529	24.928	34.547	188.780
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	3.598	142.529	24.928	34.547	188.780
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	35	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	41	1	–	22
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.422	-19	–	-20
	–	-1.381	17	–	2
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 3.598	\$ 141.148	\$ 24.945	\$ 34.547	€ 188.782

Franklin Responsible Income 2028 Fund^ zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)

Stufe 1	
Anleihen und Schuldtitel	€ –
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	–
Level 2	
Anleihen und Schuldtitel	€ 34.759
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	34.759
Stufe 3	
Anleihen und Schuldtitel	€ –
Geldmarktinstrumente	–
Eigenkapitalinstrumente	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–
	–
Anlagen insgesamt	€ 34.759

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 und Verbindlichkeiten zum 28. Februar 2022 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	151
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	784	6.335	567	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-1.751	-10.440	-590	–
	–	-967	-4.105	-23	151
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 669.444	\$ 229.242	\$ 1.443.084	€ 145.806	\$ 49.581
Geldmarktinstrumente	270.000	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	5.470	34.088	808	65
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	2.494	15.164	131	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-471	-11.070	-1.315	-29
	939.444	236.735	1.481.266	145.430	49.618
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ 154	\$ 880	€ –	\$ 921
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	154	880	–	921
Anlagen insgesamt	\$ 939.444	\$ 235.922	\$ 1.478.041	€ 145.407	\$ 50.690

	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	438	2.853	–	–	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	104	47	–	1	51
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-1.281	-72	-89	-27	–
	-739	2.828	-89	-26	52
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 254.048	\$ 250.188	\$ 33.229	\$ 27.090	\$ 69.150
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	28.957	1490	4.048	–	6.632
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4.595	112	164	9	193
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-2.922	-60	-188	-39	-139
	284.678	251.730	37.253	27.060	75.836
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 2	\$ 683	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	662	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2	1345	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 283.941	\$ 255.903	\$ 37.164	\$ 27.034	\$ 75.888

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	315	-	2.194	837	437
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-236	-1.113	-181	-1.170	-44
	79	-1.113	2.013	-333	393
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 54.893	\$ 480.459	\$ 438.717	\$ 179.636	\$ 73.736
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	3.010	12.311	6.636	20.460	718
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	379	8133	4.176	1.939	827
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-586	-594	-4.645	-3.423	-509
	57.696	500.309	444.884	198.612	74772
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	-	-	1	-
Anlagen insgesamt	\$ 57.775	\$ 499.196	\$ 446.897	\$ 198.280	\$ 75.165

	Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	€ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	397	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	216.746	1.065	502	1.640
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-303.469	-2.253	-2.083	-666
	-	-86.723	-791	-1.581	974
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	€ 32.768	\$ 3.650.302	\$ 341.497	\$ 989.198	\$ 1.264.416
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	2	165.431	11.276	36257	18.650
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	364.851	5.643	4045	1.296
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-66	-400.163	-7.975	-5.374	-14
	32.712	3.780.421	350.441	1.024.126	1.284.348
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	€ -	\$ 10.679	\$ 2.684	\$ 29.159	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	2.349	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	10.679	5.033	29.159	-
Anlagen insgesamt	€ 32.712	\$ 3.704.377	\$ 354.683	\$ 1.051.704	\$ 1.285.322

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 UK Investment Grade Credit Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	59	202	196	21	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-10	-158	-614	–	–
	49	44	-418	21	–
Level 2					
Anleihen und Schuldtitel	£ 70.140	\$ 162.165	\$ 19.848	\$ 9.371	\$ 210.973
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	11.779	1.216	64	4.135
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	8	143	573	270	4.267
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-35	-1.739	-257	-26	-4.493
	70.113	172.348	21.380	9.679	214.882
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	£ –	\$ 78	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	78	–	–	–
Anlagen insgesamt	£ 70.162	\$ 172.470	\$ 20.962	\$ 9.700	\$ 214.882

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	33
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.272	–	–	–	86
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-4.865	–	–	-1.309	-81
	-3.593	–	–	-1.309	38
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 728.006	\$ 10.878	\$ 239.295	\$ 1.481.384	\$ 49.895
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	752	538	3.333	40.689	1.925
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	21.946	147	2.854	31828	233
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-22.185	-32	-4.074	-17.153	-145
	728.519	11.531	241.408	1.536.748	51.908
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 724.926	\$ 11.531	\$ 241.408	\$ 1.535.439	\$ 51.946

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Value Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	2.157	878.948	207.470
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	1.151	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-1.426	-	-	-
	-	-275	2.157	878.948	207.470
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 9.283	\$ 96.648	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	882	4.248	79	2.840	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	80	3.520	1	14	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-208	-4.556	-29	-641	-
	10.037	99.860	51	2.213	-
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Anlagen insgesamt	\$ 10.037	\$ 99.585	\$ 2.208	\$ 881.161	\$ 207.470

	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Growth Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	1.756.332	536.471	41.374	1.618.990	14.292
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	1.756.332	536.471	41.374	1.618.990	14.292
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ 836	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	4.603	113	20	145	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-1.709	-123	-38	-2.099	-
	2.894	-10	818	-1.954	-
Level 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
Geldmarktinstrumente	-	-	-	-	-
Eigenkapitalinstrumente	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	-	-	-	-	-
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
Anlagen insgesamt	\$ 1.759.226	\$ 536.461	\$ 42.192	\$ 1.617.036	\$ 14.292

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 Infrastructure Value Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	648.298	2.667	164.133	891.617	86.980
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	648.298	2.667	164.133	891.617	86.980
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	41.913	1.480
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	3.195	–	82	1468	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-438	-30	-332	-1.791	-5
	2.757	-30	-250	41.590	1.476
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	€ 651.055	\$ 2.637	\$ 163.883	\$ 933.207	\$ 88.456

	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.410	27.800	25.897	–	12.372
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	4.410	27.800	25.897	–	12.372
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	140	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	162	34	–	7
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-23	-139	–	-1
	140	139	-105	–	6
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	34	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	34	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 4.550	€ 27.973	\$ 25.792	\$ –	\$ 12.378

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 Asia Long- Term Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^] zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	15.463	170.458	27.613	47.571	302.551
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	15.463	170.458	27.613	47.571	302.551
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	197	11	–	281
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-2.114	-10	–	-69
	–	-1.917	1	–	212
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	68	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	68	–
Anlagen insgesamt	\$ 15.463	\$ 168.541	\$ 27.614	\$ 47.639	€ 302.763

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

Wertpapiere, die von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Anlageverwalter zum 28. Februar 2023 mit dem beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, sind im Anlagenportfolio aufgeführt. Für den Fall, dass kein Preis von einem Preisdienstleister verfügbar ist, kann der Bewertungsausschuss ein oder mehrere indikative Preise bei zugelassenen Brokern/Händlern einholen.

Die Bewertung anhand einer Preismatrix wird für Fonds verwendet, wenn der Bewertungsausschuss nicht in der Lage ist, ein oder mehrere Preise bei Brokern/Händlern für ein Wertpapier einzuholen, für das von einem Preisdienstleister kein Preis verfügbar ist. Bei der Bewertung anhand einer Preismatrix wird der aktuelle Marktwert eines auf US-Dollar lautenden Wertpapiers mithilfe der letzten von einem Broker/Händler erhaltenen Preisnotierung geschätzt. Dabei wird der Preis um die Änderung der Rendite desjenigen US-Schatzpapiers angepasst, dessen Duration dem des bewerteten Wertpapiers am ähnlichsten ist.

In den folgenden Tabellen ist der Wert der Wertpapiere für jeden Fonds aufgeführt, deren Preis durch Rückgriff auf einen einzelnen Broker ermittelt und vom Bewertungsausschuss zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurde:

	Von einzelнем Broker eingeholte Preise (in Tsd.)	Vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet (in Tsd.)
Zum 28. Februar 2023		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	111\$	111\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	642\$	642\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	642\$	642\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	7.808\$	7.808\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2.424\$	2.626\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	19.190\$
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	–	3\$
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	–	1\$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	–	35\$
	Von einzelнем Broker eingeholte Preise (in Tsd.)	Gerecht Geschätzt durch Bewertung Ausschuss (in Tausend)
Zum 28. Februar 2022		
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	154\$	154\$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	880\$	880\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	2\$	2\$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	662\$	662\$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	–	7.755\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	1\$	1\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	10.679\$	10.679\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	2.349\$	2.551\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	29.940\$
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	–	34€
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	–	68\$

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

Einzelheiten zu den zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die zum 28. Februar 2023 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, finden Sie im Anlagenportfolio.

Unter bestimmten Umständen nutzt die Gesellschaft die von ICE Data Services („ICE“) angepassten Preise zur Bewertung von Nicht-US-Aktien. ICE berechnet und stellt einen angepassten Schlusskurs bereit, der als angemessener Preis verwendet wird.

Zum 28. Februar 2023 wurden von ICE angepasste Preise auf den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, den FTGF ClearBridge Value Fund, den FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, den FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, den FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund und den FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income angewendet. FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] angewendet (28. Februar 2022: FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund, Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund, FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]).

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

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. Die betreffende 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 Makler 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 hinsichtlich der Kontrahenten ausgesetzt, mit denen er in Bezug auf Optionen, Terminkontrakte und andere Finanzderivate handelt, die nicht an einer anerkannten Börse gehandelt werden. Solche Instrumente genießen nicht den gleichen Schutz, wie er für Teilnehmer gilt, die an organisierten Börsen Swaps, Futures oder Optionen handeln, wie beispielsweise die Leistungsgarantie einer Clearingstelle. Die Fonds unterliegen der Möglichkeit der Insolvenz, des Konkurses oder des Ausfalls einer Gegenpartei, mit der die Fonds solche Instrumente handeln, was zu erheblichen Verlusten für die Fonds führen könnte.

Die Gesellschaft ist einem Kreditrisiko hinsichtlich der OTC-Kontrahenten ausgesetzt, mit denen sie Geschäfte tätigt. Alle OTC-Gegenparteien müssen die folgenden in den Vorschriften festgelegten Kriterien erfüllen:

- (i) Sie müssen ein Kreditinstitut gemäß Vorschrift 7 der OGAW-Vorschriften der Zentralbank oder eine gemäß der Richtlinie über Märkte für Finanzinstrumente in einem EWR-Mitgliedstaat zugelassene Wertpapierfirma oder ein Rechtsträger sein, der als „Consolidated Supervised Entity“ von der US-amerikanischen Börsenaufsicht (SEC) reguliert wird, oder
- (ii) ein Mindestrating von A2 oder ein gleichwertiges Rating aufweisen oder nach Einschätzung des jeweiligen Anlageverwalters und/oder der Unteranlageverwalter ein implizites Mindestrating von A2 oder gleichwertig aufweisen.

Das Engagement in einzelnen Kontrahenten ist bei zugelassenen Kreditinstituten in der Regel auf 10 % des Nettoinventarwerts und bei sonstigen Kontrahenten auf 5 % des Nettoinventarwerts begrenzt.

Transaktionen mit Finanzderivaten erfolgen in der Regel mit Kontrahenten, mit denen die Gesellschaft Globalverrechnungsverträge abgeschlossen hat. Globalverrechnungsverträge sehen bei einem Ausfall die Nettoverrechnung von Kontrakten mit demselben Kontrahenten für einen bestimmten Fonds vor. Das mit derivativen Finanzanlagen, die einem Globalverrechnungsvertrag unterliegen, verbundene Kreditrisiko wird nur insofern eliminiert, als dass finanzielle Verbindlichkeiten gegenüber demselben Kontrahenten nach Verwertung der Vermögenswerte verrechnet werden.

Sofern Transaktionen für einen Fonds zu großen nicht realisierten Gewinnen führen, kann es für einen Fonds erforderlich sein, eine von einem Makler erhaltene Sicherheit zu halten. In diesem Fall reduziert sich das Kreditrisiko des Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheit. Sollte der Makler Konkurs anmelden, so ist die in Verbindung mit bestimmten derivativen Finanzinstrumenten eingebrachte Sicherheit in den USA (wobei sich die Vorschriften in den verschiedenen Rechtssystemen unterscheiden können) von der bei Aufnahme des Konkursverfahrens angewandten automatischen Aussetzung ausgenommen. Diese Ausnahme für Derivate würde es einem Fonds erlauben, die von der zahlungsunfähigen Partei eingebrachte Sicherheit sofort zwangsvollstrecken zu lassen, um die Forderungen gegen die zahlungsunfähige Partei zu befriedigen.

Der Wert der als Sicherheit erhaltenen Basiswerte für gehandelte und von den folgenden Fonds gehaltenen Derivate betrug zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 22:

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Marktwert der Sicherheiten zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Morgan Stanley	\$–	433\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	JP Morgan	\$–	464\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Morgan Stanley	\$–	283\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	BNP Paribas	\$–	892\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Goldman Sachs	567\$	\$–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Morgan Stanley	\$–	5.363\$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Morgan Stanley	202\$	\$–
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Credit Suisse	\$–	753\$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	BNP Paribas	\$–	692\$
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Morgan Stanley	\$–	71\$

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

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie die Bonität und die Finanzpositionen der Gegenparteien, mit denen die Fonds Geschäfte abschließen, regelmäßig überprüft. Die Fonds dürfen nur mit genehmigten Gegenparteien handeln. Es wird ein Verzeichnis der zugelassenen Gegenparteien geführt und die Fonds dürfen nur mit diesen zugelassenen Gegenparteien Geschäfte abschließen. Ergänzungen dieser Listen werden vierteljährlich überprüft und jedes Jahr wird eine sorgfältige Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung schließt die Analyse der Eigenkapitalausstattung, der Rentabilität, der Liquidität und anderer maßgeblicher Faktoren der Gegenparteien ein.

Für eine effiziente Portfolioverwaltung kann jeder Fonds gemäß den Bestimmungen und Beschränkungen der OGAW-Vorschriften der irischen Zentralbank Wertpapierpensionsgeschäfte, umgekehrte Wertpapierpensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihverträge abschließen.

Bis zum Ablauf der Wertpapierpensionsgeschäfte, der umgekehrten Wertpapierpensionsgeschäfte sowie der Wertpapierleihgeschäfte muss die im Rahmen eines solchen Vertrags oder Geschäfts erhaltene Sicherheit:

- (i) täglich neu bewertet werden;
- (ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der geliehenen Wertpapiere entsprechen oder darüber liegen;
- (iii) auf den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden; und
- (iv) dem Fonds sofort und ohne Rückgriff auf die Gegenpartei zur Verfügung stehen, falls dieses Rechtssubjekt in Verzug gerät.

Jede von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheit kann nicht verkauft oder weiterverpfändet werden, sondern muss zum Kreditrisiko der Gegenpartei gehalten und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden. Dem Kreditrisiko begegnet man durch diversifizierten Einsatz von Gegenparteien und durch Mindestratings für einzelne Wertpapiere und Durchschnittsratings für die Portfolios. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können Portfoliobeschränkungen festlegen und auf der Grundlage interner Parameter mit gemeinsam bei Auflegung des Fonds vereinbarten Beschränkungen investieren, wozu Beschränkungen für Emissionen und Emittenten, Mindestbonität sowie durchschnittliche Bonität zählen. Das Depot wird dabei laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Darüber hinaus können vor dem Kauf strenge unabhängige Analysen aller Anleihepapiere durchgeführt werden, unter anderem Finanzmodellierung, Szenarioanalysen sowie die Überwachung von Veränderungen des Risikoprofils. Generell dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs maximal 5 % des Portfolios in ein und dasselbe emittierende Unternehmen angelegt sein.

Der Bewertungsausschuss trifft sich mindestens einmal monatlich und wenn die Umstände dies erfordern, um Fragen der Bewertung zu erörtern und unter anderem auch das Kreditrisiko zu prüfen. Der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter legt dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Im Wesentlichen werden alle von den Fonds gehaltenen Barmittel und Wertpapiere über die Verwahrstelle gehalten, die ein Rating von AA- hat (28. Februar 2022: 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. Sollte sich die Bonität oder finanzielle Lage der Verwahrstelle erheblich verschlechtern, kann der jeweilige Anlagemanager und/oder Unteranlageverwalter den Barmittelbestand auf eine andere Bank übertragen.

Sämtliche als Sicherheit platzierte Wertpapiere sind im Anlagenportfolio aufgeführt. Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente, die auf den Depotbank- und Margenkonto gehalten werden und die Barmittel sind, werden in der Rechnung der Finanzlage ausgewiesen.

Wenn ein Fonds eine Sicherheit bei einer Gegenpartei hinterlegt hat, so kann der Fonds bei Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsverträgen mit der Gegenpartei berechtigt sein, diese Sicherheit zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch bestrebt sein, alle der Gegenpartei geschuldeten Beträge zu reduzieren, um alle noch offenen Geschäfte durch Verrechnung der geschuldeten Beträge gegen die eingebrachte Sicherheit zu verrechnen. Wenn der Fonds nach Verrechnung der geschuldeten Beträge Anspruch auf Rückzahlung einer Sicherheit hätte (wenn z.B. die Fondsposition überbesichert war), dann hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich eine unbesicherte Forderung gegen den Kontrahenten über den Betrag, der den ihm geschuldeten Betrag übersteigt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

Die folgende Tabelle weist den Marktwert der Wertpapiere aus, die in Bezug auf den Handel mit Derivaten als Sicherheit bei Brokern zum 28. Februar 2023 und 28. Februar 2022 platziert waren:

Fonds	Broker	Marktwert der Sicherheiten zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Marktwert der Sicherheiten zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	\$–	280\$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	\$–	89\$
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Citi	152\$	\$–
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	JP Morgan	\$–	314\$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	1.590\$	\$–

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

Zur Reduzierung des Gegenparteiausfallrisikos werden bestimmte außerbörsliche Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Vereinbarung werden mit Gegenparteien abgeschlossene Transaktionen an Clearingstellen abgetreten, die nach der Annahme effektiv die Gegenpartei für die Risikoaspekte der Transaktion ersetzen.

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Zusammenfassung des Kreditrisikos basierend auf den Ratings der in den Rentenfonds enthaltenen Schuldtitel:

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. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	100,00 %	72,81 %	AAA	54,62 %	47,10 %	AAA	44,86 %	45,02 %	AAA	20,84 %	24,57 %
Kein Rating	–	27,19 %	AA	10,57 %	11,07 %	AA	5,62 %	5,26 %	AA	26,73 %	22,15 %
			A	16,58 %	18,44 %	A	15,52 %	15,20 %	A	23,27 %	24,74 %
			BBB	17,85 %	19,94 %	BBB	21,97 %	19,35 %	BBB	24,69 %	24,89 %
			BB	0,38 %	0,67 %	BB	8,18 %	8,44 %	BB	3,57 %	2,67 %
			CCC & niedriger	–	–	B	1,51 %	2,85 %	B	0,90 %	0,98 %
			Kein Rating	–	2,78 %	CCC & niedriger Kein Rating	–	2,34 %	–	2,10 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

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 [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
BBB	–	10,05 %	AAA	12,54 %	3,71 %	A	0,24 %	–	AAA	–	2,74 %
BB	–	41,49 %	AA	1,27 %	1,22 %	BBB	5,14 %	10,04 %	AA	–	1,62 %
B	–	39,45 %	A	7,23 %	6,53 %	BB	30,19 %	38,40 %	A	–	9,02 %
CCC & niedriger	–	5,24 %	BBB	35,87 %	38,17 %	B	47,96 %	40,14 %	BBB	–	44,63 %
Kein Rating	–	3,77 %	BB	27,14 %	31,77 %	CCC & niedriger Kein Rating	–	2,80 %	BB	–	30,15 %
			B	13,35 %	16,07 %				B	–	11,61 %
			CCC & niedriger Kein Rating	2,40 %	2,51 %				CCC & niedriger	–	0,23 %
	0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global High Yield Fund			Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]			FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AA	–	3,97 %	AAA	4,85 %	–	AAA	–	65,48 %	AAA	11,27 %	3,21 %
A	–	3,64 %	BBB	3,26 %	16,12 %	AA	–	10,87 %	AA	20,43 %	16,36 %
BBB	–	48,05 %	BB	33,42 %	47,45 %	A	–	10,52 %	A	29,69 %	32,21 %
BB	–	32,90 %	B	44,10 %	29,73 %	BBB	–	11,66 %	BBB	26,60 %	31,43 %
B	–	11,00 %	CCC & niedriger Kein Rating	14,22 %	5,95 %	BB	–	1,47 %	BB	0,66 %	–
CCC & niedriger	–	0,44 %		0,15 %	0,75 %				B	–	–
	0,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %	Not Rated	11,35 %	16,79 %
										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 [^]			Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	18,93 %	18,78 %	AAA	32,86 %	37,05 %	AAA	11,77 %	2,96 %	AA	–	0,32 %
AA	27,37 %	25,34 %	AA	15,13 %	9,75 %	AA	2,67 %	2,90 %	BBB	–	4,67 %
A	53,43 %	55,38 %	A	27,67 %	27,60 %	A	21,00 %	28,97 %	BB	–	44,13 %
BBB	0,27 %	0,50 %	BBB	17,24 %	20,71 %	BBB	57,17 %	53,75 %	B	–	46,14 %
			BB	6,19 %	4,16 %	BB	7,39 %	10,00 %	CCC & niedriger	–	4,74 %
			B	0,91 %	0,73 %	B	–	0,25 %			
						Ohne Rating	–	1,17 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^β}			FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	20,30 %	0,78 %	AAA	5,53 %	7,10 %	AAA	1,35 %	0,49 %	AAA	98,38 %	97,64 %
AA	2,80 %	1,98 %	AA	0,66 %	1,21 %	AA	0,38 %	0,25 %	AA	0,10 %	–
A	5,42 %	8,85 %	A	4,15 %	1,83 %	A	1,73 %	2,74 %	A	0,22 %	0,53 %
BBB	44,03 %	58,67 %	BBB	21,63 %	20,53 %	BBB	12,14 %	3,69 %	BBB	1,07 %	0,96 %
BB	22,63 %	21,03 %	BB	38,14 %	32,49 %	BB	15,83 %	8,44 %	BB	0,23 %	–
B	4,55 %	2,97 %	B	20,23 %	22,97 %	B	18,36 %	12,67 %	Kein Rating	–	0,87 %
CCC & niedriger	0,27 %	–	CCC & niedriger Kein Rating	9,66 %	8,05 %	CCC & niedriger Kein Rating	50,21 %	12,61 %			
Kein Rating	–	5,72 %		–	5,82 %		–	59,11 %			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (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 [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	7,61 %	9,21 %	AAA	0,80 %	6,98 %	AAA	6,91 %	38,15 %	AAA	9,60 %	4,22 %
AA	9,33 %	10,55 %	AA	10,66 %	11,56 %	AA	0,42 %	2,44 %	AA	4,25 %	5,57 %
A	45,81 %	44,78 %	A	31,89 %	28,98 %	A	1,65 %	10,98 %	A	41,98 %	40,12 %
BBB	36,31 %	34,35 %	BBB	45,59 %	42,26 %	BBB	34,03 %	26,87 %	BBB	39,62 %	39,39 %
BB	0,94 %	1,11 %	BB	8,94 %	7,91 %	BB	25,58 %	12,83 %	BB	4,55 %	8,40 %
			B	2,04 %	1,10 %	B	8,50 %	4,13 %	Kein Rating	–	2,30 %
			CCC & niedriger	0,08 %	–	CCC & niedriger	2,31 %	0,44 %			
			Kein Rating	–	1,21 %	Kein Rating	20,60 %	4,16 %			
	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. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	55,13 %	47,36 %	AAA	59,94 %	38,24 %	A	0,39 %	–	AAA	50,78 %	22,15 %
AA	9,96 %	18,30 %	AA	2,93 %	15,13 %	BBB	7,12 %	2,66 %	AA	9,75 %	23,12 %
A	8,03 %	6,91 %	A	9,21 %	13,75 %	BB	36,83 %	43,83 %	A	8,22 %	20,10 %
BBB	18,38 %	19,86 %	BBB	14,30 %	20,68 %	B	43,32 %	41,86 %	BBB	20,25 %	22,75 %
BB	8,50 %	7,57 %	BB	13,62 %	12,20 %	CCC & niedriger	8,61 %	10,50 %	BB	10,90 %	11,86 %
						Kein Rating	3,73 %	1,15 %	B	0,02 %	0,02 %
									Kein Rating	0,08 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund			FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]			FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]			FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22	Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	11,57 %	16,94 %	AAA	22,78 %	16,25 %	A	0,39 %	–	AAA	27,27 %	9,45 %
AA	1,61 %	0,67 %	AA	9,04 %	2,30 %	BBB	6,82 %	2,07 %	AA	14,11 %	18,21 %
A	7,74 %	5,77 %	A	11,44 %	17,22 %	BB	41,27 %	47,97 %	A	6,10 %	17,92 %
BBB	39,90 %	34,90 %	BBB	22,46 %	13,24 %	B	48,05 %	49,24 %	BBB	26,76 %	31,87 %
BB	18,89 %	20,58 %	BB	9,63 %	17,77 %	CCC & niedriger	0,81 %	0,72 %	BB	25,76 %	22,55 %
B	14,48 %	15,64 %	B	6,93 %	11,71 %	Kein Rating	2,66 %	–			
CCC & niedriger	5,81 %	5,11 %	CCC & niedriger	2,22 %	5,74 %						
Kein Rating	–	0,39 %	Kein Rating	15,50 %	15,77 %						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		
Rating	Feb. 23	Feb. 22
AAA	8,27 %	–
AA	3,00 %	–
A	9,72 %	–
BBB	47,17 %	–
BB	15,96 %	–
B	13,72 %	–
CCC & niedriger	2,16 %	–
	100,00 %	0,00 %

β Das Portfolio wird auf Bottom-up-Basis unter Anwendung des fundamentalen Value-Prozesses von Western Asset zusammengestellt. Das Investmentteam verlässt sich nicht auf das Research von Ratingagenturen, sondern bewertet deren Arbeit und Verbesserungsniveau bei Wertpapieren. Bei Wertpapieren, die nicht von einer national anerkannten statistischen Ratingorganisation (NRSRO) bewertet sind, vergibt das Investmentteam ein internes Rating auf der Grundlage der Fundamentalanalyse des Investmentteams.

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 Anteilshabern jederzeit erfüllen muss.

Die Verwaltungsstelle überwacht das Zeichnungs- und Rücknahmenvolumen täglich und benachrichtigt den betreffenden Anlageverwalter oder die Unteranlageverwalter über etwaige wesentliche Bewegungen und ungewöhnliche Trends. Wenn Rücknahmeanträge an einem Handelstag (wie im Prospekt definiert) 10 % der ausgegebenen Anteile eines Fonds übersteigen, kann die Gesellschaft beschließen, die Gesamtzahl der an diesem Handelstag zurückgenommenen Anteile auf 10 % der umlaufenden Anteile des Fonds zu beschränken; in diesem Fall werden alle betroffenen Rücknahmeanträge anteilig gekürzt. Die Gesellschaft stellt über das Limit hinausgehende Rücknahmeanträge zurück und behandelt die zurückgestellten Anträge so, als wären sie für den jeweils darauffolgenden Handelstag eingegangen (in Bezug auf den die Gesellschaft die gleiche Befugnis zum Zurückstellen mit dem dann geltenden Limit hat), bis alle Anteile zurückgenommen wurden, auf den sich der ursprüngliche Antrag bezogen hat. In diesen Fällen kann die Gesellschaft die Anträge am nächsten und den folgenden Handelstagen anteilig kürzen, um die oben genannte Beschränkung umzusetzen.

Die Gesellschaft kann die Bestimmung des Nettoinventarwerts eines Fonds sowie den Verkauf oder die Rücknahme von Anteilen vorübergehend in jedem Zeitraum aussetzen:

- während dessen ein Markt, welcher der wichtigste Markt für einen erheblichen Teil der Anlagen eines Fonds ist, geschlossen ist oder solange der Handel darauf eingeschränkt oder einstweilen ausgesetzt ist;
- während dessen eine Notlage besteht, infolge derer ein Fonds Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens eines Fonds darstellen, praktisch nicht veräußern kann;
- während dessen die Preise von Anlagen eines Fonds aus irgendeinem Grund vom Fonds nicht angemessen, unverzüglich oder exakt ermittelt werden können;
- während dessen die Überweisung von Mitteln, die für Käufe und Verkäufe von Fondsanlagen benötigt werden, nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu üblichen Wechselkursen erfolgen kann; oder
- während dessen der Erlös aus dem Verkauf oder der Rücknahme von Anteilen nicht auf das Konto eines Fonds oder von diesem Konto überwiesen werden kann.

Das Unternehmen hat die Möglichkeit, kurzfristig Kredite aufzunehmen, um die Abrechnung sicherzustellen. Gemäß den UCITS Regulations darf ein Fonds nur wie folgt Kredite aufnehmen:

- Ein Teilfonds darf im Rahmen von Parallelkrediten Fremdwährungen kaufen und
- ein Fonds kann Kredite aufnehmen:
 - bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern die Kreditaufnahme vorübergehender Natur ist, und
 - bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern die Kreditaufnahme den Erwerb von Immobilien ermöglichen soll, die für seinen Geschäftszweck erforderlich sind,

wobei die in Buchstabe b (i) und b (ii) genannte Kreditaufnahme insgesamt 15 % des Vermögens des Kreditnehmers nicht überschreiten darf.

Global Credit Fixed

Mit Wirkung zum 5. Februar 2021 schloss das Unternehmen zusammen mit anderen in Europa und den USA registrierten Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzeln „Darlehensnehmer“, zusammen „Darlehensnehmer“), eine gemeinsame syndizierte vorrangige unbesicherte Kreditfazilität in Höhe von insgesamt 2.675 Millionen USD (die „Globale Kreditfazilität“) ab, um den Darlehensnehmern eine Finanzierungsquelle für vorübergehende und Notfallzwecke bereitzustellen, einschließlich der Möglichkeit, zukünftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich große Rückzahlungsanträge zu erfüllen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Weltweite Kreditlinie (Global Credit Facility) – (Fortsetzung)

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 Geltungsbereich der Global Credit Facility.

Eine der Aufgaben des Bewertungsausschusses besteht darin, Bewertungsprobleme, einschließlich illiquider Wertpapiere, zu prüfen und darüber zu beraten. Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in außerbörslich gehandelte Derivatkontrakte investieren, die nicht an einem organisierten öffentlichen Markt gehandelt werden und möglicherweise illiquide sind. Infolgedessen ist die Gesellschaft möglicherweise nicht in der Lage, ihre Anlagen in diese Instrumente schnell zu einem Betrag nahe ihrem beizulegenden Zeitwert zu liquidieren, um ihren Liquiditätsbedarf zu decken oder auf bestimmte Ereignisse wie eine Verschlechterung der Kreditwürdigkeit eines bestimmten Emittenten zu reagieren.

Die nachstehenden Tabellen wurden auf der Grundlage der undiskontierten Bruttomittelabflüsse im Zusammenhang mit den jeweiligen Finanzverbindlichkeiten erstellt. Die in den folgenden Tabellen aufgeführten Devisenterminkontrakte werden auf Bruttobasis abgerechnet. Einzelheiten zu den Bruttoabrechnungsbeträgen für diese Kontrakte finden Sie im jeweiligen Anlagenportfolio.

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 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD –	\$ –	\$ 620	\$ 659	\$ 849	\$ 1.199	€ –	€ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	2.826	2642	445	2114	9	508
Optionen	–	–	18	220	161	1420	4	–
Swapkontrakte	–	–	46	421	1867	3508	–	743
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	50	709	820	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	7	–	1.793	1273	868	84
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	9.879	19972	11726	5654	101191	44980	187	1
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	2.054	6	132	55	148	48	1	–
Fällige Managementgebühr	363	55	71	141	487	668	3	2
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	24	22	16	17	73	78	14	10
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	1	16	20	31	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1	1814	1904	3508	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	833615	919324	131919	232906	1148700	1488090	132467	149386
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	9	–	56	–	3
Swaptions	–	–	–	–	–	258	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	1.869	6484	338	569
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	52	–	454	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	173	1522	1832	7691	197	506
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	298	379	116	86	375	283	55	52
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 846.233	\$ 939.758	\$ 147.724	\$ 246.212	\$ 1.262.877	\$ 1.562.509	€ 134.143	€ 151.865

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 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD 140	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	38	51	–	–	–	–	–	181
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	286
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	265	109	–	–	–	–	–	149
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	36
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	4	158	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	89	29	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	41	72	–	–	–	–	–	9
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	11	9	–	5	–	2	3	7
Fällige Informationsstellengebühren	4	8	–	–	–	–	–	1
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	1.011	–	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	57431	81978	–	–	–	–	–	59.525
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	2
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	6	30	–	–	–	–	–	149
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	200
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	94	91	14	9	17	15	42	37
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 58.123	\$ 83.546	\$ 14	\$ 14	\$ 17	\$ 17	\$ 45	\$ 60.582

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang 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 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ 559	\$ -	\$ 155	\$ 578	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -
-	-	27	330	-	190	-	127	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	657	116	19	-	8	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	29	3642	1704	35	41	-	165	-	39
-	-	-	117	-	-	-	-	-	-
-	214	266	42	1250	341	-	-	-	-
12	16	94	28	172	59	-	3	-	-
14	49	91	114	67	119	-	18	-	1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	24	20	20	14	18	3	19	3	6
2	5	6	7	7	9	-	1	-	-
1.366	488	45	2408	74	5179	11	10	-	44
-	52.992	227355	302969	125240	259100	-	41.118	-	27.848
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	366	561	-	-	-	9	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	6	-	-
-	-	3	-	-	-	-	-	-	-
-	-	29	1164	31	72	-	89	-	27
23	38	184	164	79	75	48	42	32	29
\$ 1.426	\$ 53.855	\$ 232.687	\$ 310.285	\$ 127.240	\$ 265.800	\$ 62	\$ 41.615	\$ 35	\$ 27.994
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 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ 522	\$ -	\$ 484	\$ 161	\$ -	\$ 5	\$ -	\$ 9	€ -	€ -
6	-	1	1642	17	777	3	339	-	-
-	-	-	-	4	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.508	76	393	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
789	266	3188	4524	1985	1280	69	103	-	-
373	1113	-	-	747	253	-	-	-	-
770	120	25758	5838	9282	3922	306	3	-	140
15	7	2	-	-	-	-	-	-	-
200	241	153	137	17	32	2	2	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
32	30	36	26	15	15	9	9	3	5
13	19	11	10	-	-	-	-	-	-
299	1467	1106	7487	72	3467	-	5	-	-
437707	509794	523970	444249	146703	202948	46050	77353	-	37.448
-	-	-	-	-	8	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	328	31	121	98	627	21	13	-	66
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
341	-	-	-	14	-	-	-	-	-
-	-	61	181	296	917	34	44	-	-
313	403	84	86	101	91	56	53	28	48
\$ 441.380	\$ 513.788	\$ 554.885	\$ 464.462	\$ 159.351	\$ 215.850	\$ 46.626	\$ 78.326	€ 31	€ 37.707

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset EM Local Currency Debt Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Verbindlichkeiten (in Tsd.)						
Geringer als 1 Monat						
Überziehung (Barmittel)	USD 83.849	\$ 101.514	\$ –	\$ –	\$ 2	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	76579	266033	–	–	119	836
Optionen	36.086	53594	–	–	–	14
Swapkontrakte	43.002	239384	–	–	761	572
Swaptions	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	19.856	43262	–	–	2.113	3533
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	21.228	5137	–	–	63	43
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	4.384	14790	–	–	7.800	2415
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	2062	4149	–	–	24	27
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	151	243	–	5	22	22
Fällige Informationsstellengebühren	136	279	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	3.140	23005	–	–	82	61
Rückkaufbare und gewinnberechtignte Anteile	2132501	4183834	–	–	275.012	371899
1 – 3 Monate						
Optionen	4.816	72352	–	–	24	163
Swaptions	–	528	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	23.760	54894	–	–	852	3707
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate						
Optionen	5.450	1754	–	–	12	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	25.966	232727	–	–	827	2196
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	1.652	3399	30	25	207	177
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 2.484.618	\$ 5.300.878	\$ 30	\$ 30	\$ 287.920	\$ 385.665

	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Verbindlichkeiten (in Tsd.)								
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD –	\$ –	\$ 4	\$ 3	\$ 7	\$ 13	\$ –	\$ 1
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	26	5	850	1190	2495	5014	–	90
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	12
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	78	4	2038	2791	17448	11667	149	4
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	4.865	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	145	–	490	230	1798	–	163	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	1	–
Fällige Managementgebühr	–	–	83	124	260	150	–	2
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	13	5	24	16	38	42	7	5
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	11	18	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	2.595	638	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtignte Anteile	8995	9866	162009	215635	539271	752718	10394	11590
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	29	22	1928	1692	6179	10197	53	16
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	10	–	321	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	5	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	31	23	386	478	247	431	44	45
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 9.322	\$ 9.925	\$ 170.418	\$ 222.825	\$ 567.743	\$ 785.418	\$ 10.811	\$ 11.765

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]		FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]		FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]		Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ 878	\$ 189	£ -	£ -	\$ -	\$ 10	\$ -	\$ -
-	380	54	2408	-	-	6	280	389	-
-	-	-	-	-	-	-	-	21	67
-	592	-	-	-	-	74	-	2	68
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1683	3513	-	14	-	-	361	1637	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	55	154
-	-	83.125	200768	229	-	1.787	-	193	661
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
77	255	13	-	-	-	4	5	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
38	56	69	60	11	7	12	13	31	17
2	2	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
559548	1057941	1119507	1147280	45912	73633	94775	175169	18441	21958
-	-	-	-	-	-	-	-	1	14
-	561	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	7	35	43	102	58	189
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	16	-
-	708	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
73	2083	731	666	29	10	103	158	65	379
350	309	222	207	45	39	64	57	52	40
\$ 561.771	\$ 1.066.400	\$ 1.204.599	\$ 1.351.592	£ 46.233	£ 73.724	\$ 97.229	\$ 177.431	\$ 19.324	\$ 23.547
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		Legg Mason Brandywine Global Sovereign Credit Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ 3	\$ 4	\$ -	\$ -	\$ 1	\$ 10.850	\$ -	\$ 325	\$ 103	\$ -
110	610	-	-	-	2.390	-	20	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	878	-	37	-	-	12
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1723	2089	-	-	11.891	11105	311	-	144	182
-	-	-	-	2.581	-	175	40	-	-
9.308	-	-	-	5.978	61079	-	-	30	-
-	-	-	-	106	37	-	-	-	-
100	119	-	-	701	998	39	46	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
27	17	-	-	77	83	20	7	7	5
1	1	-	-	78	107	-	1	1	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
4	1	-	-	714	3099	-	-	-	-
205146	244396	-	-	1.210.305	1608073	46756	52386	8389	10163
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
2507	1970	-	-	498	6048	68	145	48	14
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
9	15	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
148	166	2173	253	1.123	1309	-	41	-	-
-	-	-	-	128	71	66	67	60	38
\$ 219.086	\$ 249.388	\$ 2.173	\$ 253	\$ 1.235.059	\$ 1.705.249	\$ 47.472	\$ 53.078	\$ 8.782	\$ 10.414

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat						
Überziehung (Barmittel)	USD 1	\$ 2	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	122	630	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	3.010	3495	44	–	20	29
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	283	903	109	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	327	508	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	5	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	13	12	4	–	7	5
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	69410	104231	14804	–	2.534	2177
1 – 3 Monate						
Optionen	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	462	1061	20	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate						
Optionen	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	10	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	523	14	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	132	115	27	–	50	29
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 73.770	\$ 111.485	\$ 15.022	\$ –	\$ 2.611	\$ 2.240

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD –	\$ 397	\$ –	\$ –	\$ 7	\$ 8.610	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	229	123	56	38	840	2099	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	179	2179	–	207	3682	1602	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	200	391	33	38	704	694	6	7
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	43	61	11	8	130	106	9	6
Fällige Informationsstellengebühren	35	50	4	5	170	108	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	176	2136	44	100	28161	12990	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	224793	538159	38528	43279	1639979	1599315	13179	16018
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	224	318	47	46	111	62	27	20
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 225.879	\$ 543.814	\$ 38.723	\$ 43.721	\$ 1.673.784	\$ 1.625.586	\$ 13.221	\$ 16.051

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Global Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ 2.030	\$ 1	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 5	\$ 1
-	-	-	-	-	-	-	-	-	4.240
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
976	641	-	-	-	-	-	-	1.284	1267
6.635	304	-	-	-	-	43	-	429	1938
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
609	567	-	-	-	-	165	196	795	1137
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
86	67	-	-	-	5	27	23	165	158
56	56	-	-	-	-	23	31	109	148
288	701	29	29	-	-	55	11979	3685	19322
929726	892238	-	-	-	-	189.610	213480	1225735	1772695
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	267	442
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
118	110	30	29	55	52	81	72	368	326
\$ 940.524	\$ 894.685	\$ 59	\$ 58	\$ 55	\$ 57	\$ 190.004	\$ 225.781	\$ 1.232.842	\$ 1.801.674

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Royce US Smaller Companies Fund	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
€ 2	€ 2	\$ -	\$ -	\$ 6	\$ 14	\$ 643	\$ 56	\$ 142	\$ 341
-	340	-	-	-	-	-	1.170	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.018	367	-	30	2229	332	1547	1654	2	5
2.286	1204	-	-	3.872	2075	1944	14230	358	99
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
826	549	-	2	377	186	624	747	83	91
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
103	53	3	5	31	14	82	68	16	12
99	69	-	-	74	42	109	130	12	15
1.022	1968	-	-	2.062	368	915	15803	37	249
1062833	671424	-	2.665	406048	173394	741529	916209	78098	87935
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
40	71	-	-	-	-	76	137	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
94	95	47	47	62	29	207	200	68	64
€ 1.068.323	€ 676.142	\$ 50	\$ 2.749	\$ 414.761	\$ 176.454	\$ 747.676	\$ 950.404	\$ 78.816	\$ 88.811

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier 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	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD –	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ 182
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	23	90	139
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	5	–	–	–	51	–	214
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	1	–	–	–	–	29	25	30
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	7	4	–	–	3	5	11	8
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	3	2	5
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	1.185	49	–	20
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	4254	4534	–	–	–	28.337	21090	25883
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	19	21	23	23	71	79	133	184
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 4.281	\$ 4.564	\$ 23	\$ 23	€ 1.259	€ 28.576	\$ 21.351	\$ 26.665

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	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 [^]	
	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
Geringer als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	USD –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus gekauften Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Ausschüttungen an Inhaber rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	–	–	–	–	–	–
Zahlbare Erfolgsprämien	–	–	–	3	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	4	–	3	–	–	–	3
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückzahlbaren, gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	51	51	38	38
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
1 – 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	28	24	65	70	–	–	23	20
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	USD 28	\$ 28	€ 65	€ 76	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

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 [^]	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 5	¥ -	¥ -	\$ -	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1	-	-	-	-
-	-	-	-	-	1.033	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12	-	-	2	12
-	-	-	-	4	6	-	-	14	11
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
59	59	2	1	2516	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	12.543	-	-	3.538	16118
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1	1	39	55	49	45	114974	97595	74	76
\$ 60	\$ 60	\$ 41	\$ 56	\$ 2.569	\$ 13.645	¥ 114.974	¥ 97.595	\$ 3.628	\$ 16.217
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 [^]	
zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022	zum 28. Februar 2023	zum 28. Februar 2022
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	€ 3	€ -	€ -	€ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
1.422	2114	19	10	-	-	1	26	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
154	6577	-	280	-	-	4.372	86	815	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
76	105	18	19	26	36	55	99	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
19	17	9	6	11	9	41	34	2	-
8	12	3	5	1	2	1	2	-	-
184	15197	-	-	-	443	2603	662	-	-
141.049	169381	25121	27934	34702	47838	189097	303590	36823	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	19	43	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
45	38	95	141	116	213	37	19	22	-
\$ 142.957	\$ 193.441	\$ 25.265	\$ 28.395	\$ 34.856	\$ 48.541	€ 196.229	€ 304.561	€ 37.662	€ -

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft

Bestimmte Fonds investieren in andere Fonds der Gesellschaft. Diese übergreifenden Investitionen 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 Veränderungen bei nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, und die relevanten Dividendenerträge und Ausschüttungen aus den Kreuzbeteiligungen wurden in den in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesenen Gesamtbeträgen der Gesellschaft eliminiert; und
- die monetären Beträge von Käufen und Verkäufen von Anteilen solcher Organismen für gemeinsame Anlagen wurden aus dem Nettoerlös aus dem Verkauf von Anteilen bzw. den Anschaffungskosten der zurückerworbenen Anteile in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückzahlbarer, gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens ausgewiesen sind, eliminiert.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Der FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund hielt am Ende des Geschäftsjahres keine (2022: keine), keine (2022: 75.173) bzw. keine (2022: 51.333) Anteile am FTGF Western Asset US High Yield Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$–	123\$	83\$	354\$	\$–	\$–
Rücknahme von Anteilen	–	(10.502)	(6.388)	(1.293)	(9.302)	(5.037)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	–	613	(1.391)	(98)	979	1315
Erhaltene Ausschüttungen	–	123	83	354	–	–
Anschaffungskosten	–	–	–	7.696	–	8.323
Beizulegender Zeitwert	–	–	–	6.804	–	10.500
Nicht realisierter Gewinn/Verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$–	\$–	\$–	(892)\$	\$–	2.177\$

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]

Der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] hielt am Ende des Geschäftsjahres keine (2022: 44.725) Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	53\$	2.868\$
Rücknahme von Anteilen	(3.781)	(308)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(756)	28
Erhaltene Ausschüttungen	53	169
Anschaffungskosten	–	4.483
Beizulegender Zeitwert	–	4.048
Nicht realisierter Nettoverlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$–	(435)\$

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Der FTGF Western Asset Global High Yield Fund hielt am Ende des Geschäftsjahres keine (2022: 20.491) bzw. keine (2022: 18.300) Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]		Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	20\$	1.533\$	\$–	\$–
Rücknahme von Anteilen	(1.761)	(1.500)	(3.283)	(1.736)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(378)	(4)	295	425
Erhaltene Ausschüttungen	20	83	–	–
Anschaffungskosten	–	2.119	–	2.988
Beizulegender Zeitwert	–	1.855	–	3.743
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$–	(264)\$	\$–	755\$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

13. Angaben zu gegenseitigen Anlagen durch die Fonds innerhalb der Gesellschaft – (Fortsetzung)

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Der Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] hielt am Ende des Geschäftsjahres keine (2022: 32.057) Anteile am Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	39\$	466\$
Rücknahme von Anteilen	(2.706)	(6.502)
Realisierter Netto(verlust)/-gewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	(503)	248
Erhaltene Ausschüttungen	39	284
Anschaffungskosten	–	3.170
Beizulegender Zeitwert	–	2.902
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	\$–	(268)\$

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] hielt am Ende des Geschäftsjahres 29.816 (2022: 29.816) Anteile am FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]. Im Geschäftsjahr durchgeführte Transaktionen mit diesen Anteilen und die entsprechenden Gewinne, Verluste und Ausschüttungen:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2022 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	\$–	\$–
Rücknahme von Anteilen	–	(7.509)
Realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	–	698
Erhaltene Ausschüttungen	–	–
Anschaffungskosten	3.500	3500
Beizulegender Zeitwert	3.886	3871
Nicht realisierter Nettogewinn aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten	386\$	371\$

14. Bedeutende Ereignisse

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

Mit Wirkung zum 21. Juni 2022 stellten der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^] und der Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung zum 11. Juli 2022 stellte der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^] den Handel ein.

Am 17. Juni 2022 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrags- und ein Fachprospekt herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Die wichtigsten Änderungen sind:

- Aufnahme eines neuen Fonds: Western Asset China Bond Fund; und
- Hinzufügung weiterer Ausschüttungshäufigkeiten für bestimmte ausschüttende Anteilklassen für die folgenden Fonds: FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund und FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^].

Mit Wirkung vom 1. Juli 2022 ersetzte Franklin Templeton Investments (Asia) Limited Legg Mason Asset Management Hong Kong Limited als zusätzliche Vertriebs- und Dienstleistungsstelle der Gesellschaft.

Seit dem 3. Oktober 2022 ist Joseph Carrier nicht mehr in Vollzeit bei Franklin Templeton Investments beschäftigt. Herr Carrier wird weiterhin als nicht geschäftsführendes Mitglied des Verwaltungsrats der Gesellschaft tätig sein und ab dem 3. Oktober 2022 genauso vergütet werden wie die übrigen nicht geschäftsführenden Verwaltungsratsmitglieder der Gesellschaft.

Mit Wirkung vom 10. Oktober 2022 hat der Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Mit Wirkung vom 17. November 2022 hat der Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^] den Handel eingestellt.

Am 1. Dezember 2022 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrags- und ein Fachprospekt herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Zu den wesentlichen Änderungen gehörten Änderungen des Basisprospekts und bestimmter Fondsnachträge wie folgt:

- Änderung der Klassifizierung von einer bestehenden Klassifizierung nach Artikel 6 zu einer Klassifizierung nach Artikel 8 gemäß der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor („SFDR“) für die folgenden Fonds: FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund und FTGF Western Asset US Core Bond Fund. Die Nachträge für die betreffenden Fonds wurden aktualisiert und enthalten die erforderlichen Angaben gemäß Artikel 8. Angaben laut Taxonomie wurden ergänzt, um klarzustellen, dass unter Umständen keine Investments vorhanden sind, die laut der Taxonomieverordnung als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gelten. Die Fonds können jedoch Anlagen halten, die zur Minderung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel beitragen.
- Die Taxonomie-Angaben der folgenden Fonds wurden aktualisiert, um deutlich zu machen, dass unter Umständen keine der Anlagen als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeit laut Taxonomieverordnung gilt. FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge Value Fund, FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund (formerly Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund) und FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]. Die Fonds können jedoch Anlagen halten, die zur Minderung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel beitragen.
- Der Abschnitt „Anlagepolitik“ der betreffenden Fonds wurde aktualisiert, um deutlich zu machen, dass für Anlagen in CoCos eine Obergrenze von 10 % gilt: Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund, 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 Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^], FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Credit Fund, FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] und FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^].
- Der Abschnitt „Anlagepolitik“ der betreffenden Fonds wurde aktualisiert, um deutlich zu machen, dass für Anlagen in CoCos eine Obergrenze von 5 % gilt: FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^] und FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Signifikante Ereignisse – (Fortsetzung)

- Die jährliche Verwaltungsgebühr der Anteilsklasse Premier und X des FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund wurde im Prospekt von 0,55 % auf 0,45 % reduziert. Die jährliche Verwaltungsgebühr der Anteilsklasse S wurde im Prospekt von 0,45 % auf 0,35 % reduziert und wird somit an die tatsächlich erhobenen Gebühren angepasst.
- Die Anlagepolitik des FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund wurde aktualisiert: Hinzugefügt wurde die Möglichkeit, in Schuldtitel ohne Rating zu investieren. Alle vom Fonds erworbenen Schuldtitel weisen entweder ein Investment-Grade-Rating oder, falls kein Rating vorliegt, nach Einschätzung des Anlageverwalters zum Zeitpunkt des Erwerbs eine vergleichbare Qualität auf; und
- der Name des Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Ex Japan Real Income Fund wurde in FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund geändert.

Mit Wirkung vom 1. Dezember 2022 hat der FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 5. Dezember 2022 hat der Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^] den Handel eingestellt.

Martin Currie Investment Management Ltd hat gemäß einem Unteranlageverwaltungsvertrag vom 1. Januar 2023 in der jeweils gültigen Fassung Templeton Asset Management Ltd. (vormals Legg Mason Asset Management Singapore Pte. Limited) zum Unteranlageverwalter des Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^] und Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^] ernannt.

Mit Wirkung vom 23. Januar 2023 hat der Franklin Responsible Income 2028 Fund[^] den Handel aufgenommen.

Mit Wirkung vom 16. Februar 2023 hat der Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^] den Handel eingestellt.

Am 21. Februar 2023 wurden von der Gesellschaft ein Nachtrags- und ein Fachprospekt herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt. Mit Wirkung zum selben Datum wurde der Name der Gesellschaft in Franklin Templeton Global Funds plc geändert, um dem Namen der Verwaltungsgesellschaft der Gesellschaft – Franklin Templeton International Services S.à r.l. – Rechnung zu tragen. Im Zuge dessen wurden auch die folgenden Fonds umbenannt:

Fonds	Änderungen für den Fonds
Legg Mason Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Fixed Income Fund	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund
Legg Mason Brandywine Global High Yield Fund [^]	FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Income Optimiser Fund	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund
Legg Mason Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund
Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]
Legg Mason Western Asset Asian Income Fund	FTGF Western Asset Asian Income Fund
Legg Mason Western Asset Asian Opportunities Fund	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund
Legg Mason Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund
Legg Mason Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund
Legg Mason Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset Global Credit Fund [^]	FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset Global High Yield Fund	FTGF Western Asset Global High Yield Fund
Legg Mason Western Asset Global Multi Strategy Fund	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund
Legg Mason Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset Infrastructure Debt Fund	FTGF Western Asset Infrastructure Debt Fund
Legg Mason Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset Short-Dated High Yield Fund	FTGF Western Asset Short-Dated High Yield Fund
Legg Mason Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]
Legg Mason Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]
Legg Mason Western Asset US Core Bond Fund	FTGF Western Asset US Core Bond Fund
Legg Mason Western Asset US Core Plus Bond Fund	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund
Legg Mason Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]
Legg Mason Western Asset US High Yield Fund	FTGF Western Asset US High Yield Fund
Legg Mason Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]
Western Asset China Bond Fund	FTGF Western Asset China Bond Fund
Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]
Legg Mason Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Global Growth Fund [^]	FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]
Legg Mason ClearBridge US Aggressive Growth Fund	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund
Legg Mason ClearBridge US Appreciation Fund	FTGF ClearBridge US Appreciation Fund
Legg Mason ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]
Legg Mason ClearBridge US Large Cap Growth Fund	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund
Legg Mason ClearBridge Value Fund	FTGF ClearBridge Value Fund
Legg Mason Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]
Legg Mason Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund	FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund
Legg Mason Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]
Legg Mason Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]
Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund
Legg Mason Royce US Small Cap Opportunity Fund	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund
Legg Mason Royce US Smaller Companies Fund	FTGF Royce US Smaller Companies Fund
Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]
Legg Mason ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund
Legg Mason ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Legg Mason Brandywine Global – EM Macro Bond Fund	FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund
Legg Mason Multi-Asset Infrastructure Income Fund	FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund
Legg Mason Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]

Am 28. Februar 2023 wurden die Zulassungen für den Legg Mason ClearBridge Global Equity Income Fund[^], Legg Mason Martin Currie Japan Absolute Alpha Fund[^] und Legg Mason Martin Currie Global Dividend Opportunities Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank zurückgenommen.

Am 24. Februar 2022 begann Russland mit militärischen Operationen in der Ukraine. Die anhaltende politische und finanzielle Unsicherheit in Bezug auf Russland und die Ukraine kann die Marktvolatilität und das wirtschaftliche Risiko einer Anlage in Wertpapieren in diesen Ländern und anderen betroffenen Ländern in der Region erhöhen. Aufgrund der Sanktionen, der Maßnahmen der Regierungen, der Entwicklungen in der Ukraine selbst und anderer Umstände beobachtet der Anlageverwalter die Auswirkungen auf die Bewertung und Liquidität sehr genau und wird bei Bedarf Maßnahmen gemäß den Bewertungsrichtlinien und -verfahren der Fonds ergreifen.

Während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2023 fanden keine sonstigen bedeutenden Ereignisse statt.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Dachfonds mit getrennter Haftung zwischen den Teilfonds. Gemäß irischem Recht haften das Vermögen der einzelnen Fonds nicht für die Verbindlichkeiten der übrigen Fonds der Gesellschaft. Ungeachtet dessen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor Gerichten einer anderen Gerichtsbarkeit Bestand hat.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Anhang zum Abschluss – (Fortsetzung)

16. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

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

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

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

Es gab keine sonstigen wichtigen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die im Abschluss offengelegt werden müssten.

17. Genehmigung des Jahresberichts und ungeprüften Abschlusses

Der Verwaltungsrat hat den Jahresbericht und den geprüften Abschluss am 30. Juni 2023 genehmigt.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	0,58	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	0,56	
Klasse B USD, thesaurierend	0,89	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,01	
Klasse C USD, thesaurierend	1,00	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,06	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,41	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	0,57	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	0,56	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	0,60	
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,11	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,11	
Klasse C USD, thesaurierend	1,61	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,61	
Klasse E USD, thesaurierend	1,77	
Klasse F USD, thesaurierend	0,74	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,76	
Klasse X USD, thesaurierend	0,61	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,61	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,49	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,21	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,03	
Klasse GE USD, thesaurierend	1,62	
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,29	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,29	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,29	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,28	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,29	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,54	
Klasse C USD, thesaurierend	1,79	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,79	
Klasse E USD, thesaurierend	1,90	
Klasse F USD, thesaurierend	0,67	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,67	
Klasse X USD, thesaurierend	0,61	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,61	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,62	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,42	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,42	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,42	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,27	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,27	
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)	1,77	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,77	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,77	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,10	
Klasse A EUR, ausschüttend (D)	1,10	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,60	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,42	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,12	
Klasse GA EUR, thesaurierend	0,94	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	0,94	
Klasse GE EUR, thesaurierend	1,54	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD thesaurierend	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,38	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,38	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,38	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,38	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,38	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,38	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,38	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,63	
Klasse C USD, thesaurierend	1,88	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,88	
Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,38	
Klasse E USD, thesaurierend	1,98	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,98	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,98	
Klasse F USD, thesaurierend	0,78	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,78	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,83	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,80	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,83	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,53	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,53	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,52	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,53	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,53	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,13	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,26	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,26	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,26	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,26	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,25	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,25	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,26	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,52	
Klasse C USD, thesaurierend	1,75	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,76	
Klasse E USD, thesaurierend	1,87	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,87	
Klasse F USD, thesaurierend	0,84	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,84	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,58	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,61	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,43	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,13	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,29	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,29	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,79	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,79	
Klasse GF USD, thesaurierend	1,09	

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,29	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,28	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,29	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,29	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,29	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,28	
Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	1,26	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,29	
Klasse B USD, ausschüttend (D)	1,53	
Klasse C USD, thesaurierend	1,79	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,78	
Klasse E USD, thesaurierend	1,93	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,93	
Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,93	
Klasse F USD, thesaurierend	0,90	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,89	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,82	
Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,82	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,65	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	0,64	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,45	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,44	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,45	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	1,45	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,95	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	1,95	
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,37	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,37	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,37	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,37	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,37	
Klasse B USD, thesaurierend	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	1,87	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,87	
Klasse E USD, thesaurierend	1,97	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,97	
Klasse F USD, thesaurierend	0,97	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,97	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,72	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	0,72	
Klasse Premier EUR ausschüttend (M)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	0,72	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,12	
LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,12	
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,11	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,11	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,10	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)	0,96	
Klasse B USD, thesaurierend	1,35	
Klasse C USD, thesaurierend	1,61	
Klasse C USD, ausschüttend (M)	1,61	
Klasse E USD, thesaurierend	1,71	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,71	
Klasse F USD, thesaurierend	0,71	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,71	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,62	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,46	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,46	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,46	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,35	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,36	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,36	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,36	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,20	
Klasse X USD thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,54	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,55	
Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)	0,54	
Klasse S USD, thesaurierend	0,45	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,43	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,14	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,16	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,16	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,51	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,16	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,16	
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,76	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,76	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,76	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,75	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,75	
Klasse A GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,78	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,76	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,76	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	
Klasse B USD, thesaurierend	2,01	
Klasse C USD, thesaurierend	2,26	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	2,26	
Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	
Klasse A NOK, thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse E USD, thesaurierend	2,36	
Klasse E USD, ausschüttend (S)	2,36	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,36	
Klasse F USD, thesaurierend	1,36	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse X USD thesaurierend	1,26	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,26	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	1,26	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,26	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,26	
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,26	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,26	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,26	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,26	
Klasse X SGD, thesaurierend (abgesichert)	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,11	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	1,11	
Klasse Premier AUD thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,12	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	1,11	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	1,10	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,11	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	1,11	
Klasse S USD, thesaurierend	0,72	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,11	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,53	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,53	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,52	
Klasse C USD, thesaurierend	2,05	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,90	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,73	
Klasse S USD, thesaurierend	0,53	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	0,13	
Klasse S CHF ausschüttend (A)	0,53	
Klasse S CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,52	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,46	
Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,46	
Klasse D USD, thesaurierend	1,46	
Klasse D USD, ausschüttend (M)	1,46	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,46	
Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse M USD, ausschüttend (M)	0,86	
Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,71	
Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,39	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,09	
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]		
Klasse A GBP, thesaurierend	1,10	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,56	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M)	0,15	
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,08	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,43	
Klasse S USD, thesaurierend	0,35	
Klasse LM GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,13	
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^]		
Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	k. A.	
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F USD, thesaurierend	0,74	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,50	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S USD, thesaurierend	0,40	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,40	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (S)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,36	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,36	
Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	1,36	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,36	
Klasse B USD, thesaurierend	1,62	
Klasse B USD, ausschüttend (S)	1,61	
Klasse C USD, thesaurierend	1,86	
Klasse C USD, ausschüttend (S)	1,86	
Klasse E USD, thesaurierend	1,96	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	1,96	
Klasse F USD, thesaurierend	0,96	
Klasse F USD, ausschüttend (S)	0,97	
Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,96	
Klasse X USD thesaurierend	0,87	
Klasse X USD, ausschüttend (S)	0,87	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X GBP, thesaurierend	0,86	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	0,86	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,86	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,71	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,71	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,72	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,71	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	0,71	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,11	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,60	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,60	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,60	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,62	
Klasse C USD, thesaurierend	2,10	
Klasse E USD, thesaurierend	2,21	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,20	
Klasse F USD, thesaurierend	1,20	
Klasse X USD thesaurierend	1,15	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,15	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,15	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,00	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	1,00	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,00	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,00	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,10	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,39	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,39	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,74	
Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,57	
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,41	
Klasse A USD, ausschüttend (M)	1,41	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,45	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,41	
Klasse C USD, thesaurierend	1,91	
Klasse E USD, thesaurierend	2,01	
Klasse F USD, thesaurierend	1,01	
Klasse F USD, ausschüttend (M)	1,01	
Klasse X USD thesaurierend	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,91	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,91	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,76	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)	0,76	
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,76	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	0,11	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (D)	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,36	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,36	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,36	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,36	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,36	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	1,36	
Klasse C USD, thesaurierend	1,86	
Klasse C USD, ausschüttend (D)	1,86	
Klasse A CZK thesaurierend (abgesichert)	1,36	
Klasse E USD, thesaurierend	1,96	
Klasse E USD, ausschüttend (D)	1,96	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,96	
Klasse F USD, thesaurierend	0,91	
Klasse F USD, ausschüttend (D)	0,91	
Klasse X USD thesaurierend	0,79	
Klasse X USD, ausschüttend (D)	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,79	
Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	0,80	
Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	0,79	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,79	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,79	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,79	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,64	
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	0,63	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,63	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,60	
Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	0,64	
Klasse S USD, thesaurierend	0,46	
Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	0,46	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,46	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,46	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,46	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,12	
Klasse LM USD, ausschüttend (M)	0,11	
LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	0,11	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,11	
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,95	
Klasse X USD, ausschüttend (M)	1,45	
Klasse Premier USD, thesaurierend	1,30	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,35	
Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	0,55	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	2,29	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	2,29	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,45	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	0,14	
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,40	
Klasse S USD, thesaurierend	0,60	
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	0,60	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,60	
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,70	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
FTGF ClearBridge Value Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,80	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,80	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,80	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,81	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,80	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,80	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,80	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,80	
Klasse C USD, thesaurierend	2,30	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,30	
Klasse E USD, thesaurierend	2,55	
Klasse F USD, thesaurierend	1,20	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,20	
Klasse X USD thesaurierend	1,13	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,12	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,13	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,78	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,78	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,78	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,78	
LM Klasse USD, ausschüttend (A)	0,10	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,73	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,73	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,76	
Klasse B USD, thesaurierend	2,23	
Klasse C USD, thesaurierend	2,23	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,23	
Klasse E USD, thesaurierend	2,50	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,13	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,12	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,79	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,78	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,78	
Klasse LM USD, thesaurierend	0,15	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,15	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	2,35	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,57	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,57	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,57	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,32	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,33	
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,71	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,71	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,71	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,71	
Klasse B USD, thesaurierend	2,21	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,21	
Klasse C USD, thesaurierend	2,21	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,21	
Klasse E USD, thesaurierend	2,46	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,46	
Klasse F USD, thesaurierend	1,11	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,11	
Klasse U USD, thesaurierend	0,64	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,64	
Klasse X USD thesaurierend	1,09	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,09	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,09	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,09	
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 LM USD, thesaurierend	0,11	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,11	
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.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,75	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,75	
Klasse A GBP, thesaurierend	1,75	
Klasse A HKD, thesaurierend	1,75	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,25	
Klasse C USD, thesaurierend	2,25	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,25	
Klasse E USD, thesaurierend	2,50	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,50	
Klasse E EUR thesaurierend	2,50	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X USD thesaurierend	1,10	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,10	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,10	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,10	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,10	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,75	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,75	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,40	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	1,90	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,90	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,52	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	1,52	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,27	
Klasse GE EUR, thesaurierend	2,27	
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,75	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,75	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,75	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,75	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,75	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,75	
Klasse C USD, thesaurierend	2,25	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,25	
Klasse C USD, ausschüttend (Q)	2,25	
Klasse F USD, thesaurierend	1,15	
Klasse F EUR, thesaurierend	1,15	
Klasse F EUR, ausschüttend (A)	1,15	
Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1,13	
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,65	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,65	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,66	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,65	
Klasse A SEK, thesaurierend	1,50	
Klasse F USD, thesaurierend	1,05	
Klasse X USD thesaurierend	1,05	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,05	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,05	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,05	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,70	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,70	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,70	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,70	
Klasse S USD, thesaurierend	0,50	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,50	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,50	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,50	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	0,50	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,10	
FTGF ClearBridge Global Growth Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,80	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,80	
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,95	
Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	1,95	
Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A USD, ausschüttend (Q)	1,95	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,95	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,95	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	1,95	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	1,95	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,95	
Klasse C USD, thesaurierend	2,45	
Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	2,45	
Klasse E USD, thesaurierend	2,70	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,70	
Klasse F USD, thesaurierend	1,35	
Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	1,35	
Klasse X USD thesaurierend	1,05	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,05	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	1,05	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	1,05	
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	1,05	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier BRL thesaurierend (abgesichert)	0,85	
Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,85	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	0,85	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,85	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	0,85	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	0,85	
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,96	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,96	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,95	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A GBP ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,95	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,96	
Klasse U USD, thesaurierend	0,75	
Klasse U EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	0,75	
Klasse A GBP, thesaurierend	0,75	
Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	1,20	
Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	1,21	
Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,21	
Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	1,21	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,85	
Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus	0,85	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	0,88	
Klasse S USD, thesaurierend	0,51	
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	0,50	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Zusätzliche Informationen – Gesamtkostenquoten (Total Expense Ratios, TER) (ungeprüft) – (Fortsetzung)

	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**	Quote der Betriebskosten (Ratio of Total Operating) Ausgaben in WE(1) bis Durchschnitt Tägliches Nettovermögen des Fonds in WE(1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023**
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,97	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,97	
Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	1,97	
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	1,97	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A SGD, thesaurierend	1,97	
Klasse A SGD thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse B USD, thesaurierend	2,47	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,47	
Klasse C USD, thesaurierend	2,47	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,47	
Klasse E USD, thesaurierend	2,72	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,72	
Klasse E EUR thesaurierend	2,72	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,72	
Klasse F USD, thesaurierend	1,37	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,37	
Klasse R USD, thesaurierend	0,91	
Klasse R EUR, thesaurierend	1,47	
Klasse X USD thesaurierend	1,21	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,22	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,22	
Klasse X GBP thesaurierend	1,22	
Klasse X GBP, ausschüttend (A)	1,22	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,86	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,87	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	2,00	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	2,03	
Klasse A EUR, thesaurierend	2,03	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	2,03	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	2,03	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)	2,03	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	2,02	
Klasse C USD, thesaurierend	2,50	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,53	
Klasse E USD, thesaurierend	2,78	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,79	
Klasse E EUR thesaurierend	2,78	
Klasse F USD, thesaurierend	1,43	
Klasse F USD ausschüttend (A)	1,43	
Klasse R USD, thesaurierend	1,53	
Klasse X USD thesaurierend	1,27	
Klasse X USD, ausschüttend (A)	1,30	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,93	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	0,93	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	0,93	
Klasse LM EUR, thesaurierend	0,18	
Klasse A (G) USD, thesaurierend	1,43	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	1,93	
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	2,00	
Klasse X USD thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,24	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund		
Klasse A USD, thesaurierend	1,84	
Klasse A USD, ausschüttend (A)	1,84	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	1,84	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,84	
Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	1,84	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,84	
Klasse B USD, ausschüttend (A)	2,34	
Klasse C USD, thesaurierend	2,34	
Klasse C USD, ausschüttend (A)	2,34	
Klasse E USD, thesaurierend	2,82	
Klasse E USD, ausschüttend (A)	2,82	
Klasse F USD, thesaurierend	1,44	
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	0,89	
Klasse GA USD, thesaurierend	1,98	
Klasse GA EUR, thesaurierend	1,98	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	2,00	
Klasse GE USD, thesaurierend	2,73	
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,99	
Klasse M GBP, ausschüttend (A)	1,18	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse M USD ausschüttend (A)	1,18	
Klasse M EUR, ausschüttend (A)	1,18	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,78	
Klasse Premier GBP, thesaurierend	0,78	
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	1,98	
Klasse C USD, thesaurierend	2,48	
Klasse E USD, thesaurierend	2,73	
Klasse F USD, thesaurierend	1,38	
Klasse X USD, thesaurierend	1,23	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP, thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	1,23	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,88	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	0,88	
Klasse S USD, thesaurierend	0,53	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	0,53	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,53	
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund		
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00	
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)	2,00	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	2,00	
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1,60	
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	1,60	
Klasse D USD, thesaurierend	1,60	
Klasse X AUD, thesaurierend	1,25	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,59	
Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse LM AUD, thesaurierend	0,15	
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend	2,00	
Klasse E USD, thesaurierend	2,75	
Klasse F USD, thesaurierend	1,40	
Klasse X USD thesaurierend	1,25	
Klasse Premier USD, thesaurierend	0,90	
Klasse S USD, thesaurierend	0,70	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,70	
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^]		
Klasse A USD, thesaurierend (abgesichert)	1,97	
Klasse A EUR, thesaurierend	1,96	
Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	2,72	
Klasse X EUR, thesaurierend	1,22	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	0,87	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	0,85	
Klasse S USD, thesaurierend	0,50	
Klasse S EUR, thesaurierend	0,47	
Klasse S GBP, thesaurierend	0,47	
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Klasse A EUR, thesaurierend	0,75	
Klasse A EUR, ausschüttend (A)	0,75	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) Plus (e)	0,75	
Klasse D EUR, thesaurierend	1,30	
Klasse D EUR, ausschüttend (A)	1,30	
Klasse E EUR, thesaurierend	0,95	
Klasse K EUR, ausschüttend (A)	0,95	
Klasse X EUR, thesaurierend	0,35	
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.

Zusätzliche Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.08.2007	USD	1,78 %	1,18 %	1,39 %	5,60 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	1,78 %	1,16 %	1,37 %	5,67 %
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	1,45 %	0,92 %	1,05 %	3,83 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	1,27 %	0,78 %	0,84 %	2,96 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	1,27 %	0,77 %	0,83 %	3,05 %
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	10.10.2018	USD	1,94 %	1,29 %	1,56 %	-
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	1,78 %	1,17 %	1,39 %	5,61 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	1,78 %	1,16 %	1,37 %	5,59 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	1,79 %	1,18 %	1,41 %	5,62 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Klasse A USD thesaurierend	05.09.2007	USD	-11,77 %	-16,69 %	-12,39 %	7,44 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	-11,78 %	-16,71 %	-12,39 %	6,92 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-12,21 %	-17,11 %	-13,70 %	2,21 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	-12,21 %	-17,12 %	-13,67 %	1,72 %
	Klasse E USD, thesaurierend	16.08.2019	USD	-12,36 %	-17,24 %	-14,00 %	-
	Klasse F USD, thesaurierend	08.09.2013	USD	-11,46 %	-16,36 %	-11,07 %	-
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	27.02.2017	USD	-11,45 %	-16,37 %	-11,03 %	-
	Klasse X USD thesaurierend	13.05.2016	USD	-11,33 %	-16,28 %	-11,11 %	-
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	05.03.2016	USD	-11,32 %	-16,28 %	-11,11 %	-
	Klasse Premier USD, thesaurierend	19.04.2017	USD	-11,24 %	-16,16 %	-10,40 %	-
	Klasse LM USD, thesaurierend	04.08.2021	USD	-10,97 %	-15,91 %	-	-
	Klasse GA USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-11,70 %	-16,59 %	-11,79 %	9,77 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-12,22 %	-17,09 %	-13,36 %	3,37 %
	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-12,98 %	-18,10 %	-13,83 %
Klasse A USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-12,98 %	-18,11 %	-13,81 %	6,11 %
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		19.02.2016	USD	-12,98 %	-18,11 %	-13,82 %	-
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		19.02.2016	AUD	-14,21 %	-19,04 %	-15,98 %	-
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		06.12.2018	EUR	-15,27 %	-19,99 %	-17,89 %	-
Klasse B USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-13,33 %	-18,44 %	-14,50 %	3,41 %
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-13,41 %	-18,51 %	-15,11 %	0,94 %
Klasse C USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-13,41 %	-18,52 %	-15,10 %	0,94 %
Klasse E USD, thesaurierend		02/03/2012	USD	-13,51 %	-18,60 %	-15,37 %	-0,11 %
Klasse F USD, thesaurierend		04.05.2013	USD	-12,45 %	-17,58 %	-11,96 %	-
Klasse F USD, ausschüttend (D)		31.10.2018	USD	-12,45 %	-17,59 %	-11,94 %	-
Klasse X USD thesaurierend		20.03.2015	USD	-12,39 %	-17,56 %	-12,25 %	-
Klasse X USD, ausschüttend (D)		28.11.2017	USD	-12,40 %	-17,56 %	-12,22 %	-
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		10.10.2019	EUR	-14,77 %	-19,52 %	-16,49 %	-
Klasse Premier USD, thesaurierend		14.09.2010	USD	-12,23 %	-17,38 %	-11,30 %	17,07 %
Klasse Premier USD, ausschüttend (M)		29.09.2011	USD	-12,23 %	-17,37 %	-11,37 %	16,97 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		03.02.2016	EUR	-14,51 %	-19,24 %	-15,47 %	-
Klasse LM USD, ausschüttend (M)		13.08.2021	USD	-11,97 %	-17,13 %	-	-
Klasse LM EUR, thesaurierend		04.05.2016	EUR	-6,68 %	-11,87 %	-6,24 %	-
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		19.11.2010	GBP	-13,07 %	-18,03 %	-12,66 %	12,03 %
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	-12,97 %	-18,08 %	-13,53 %	7,52 %
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-12,96 %	-18,08 %	-13,52 %	7,48 %
Klasse B (G) USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-13,42 %	-18,48 %	-14,75 %	2,48 %
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-13,41 %	-18,48 %	-14,82 %	2,28 %	
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-13,40 %	-18,48 %	-14,80 %	2,25 %	
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund	Klasse A USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	-20,49 %	-23,31 %	-20,66 %	-21,51 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (D)	30.09.2003	EUR	-15,65 %	-18,38 %	-16,82 %	-0,24 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	-20,83 %	-23,64 %	-21,71 %	-22,66 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	03.01.2019	EUR	-15,09 %	-17,80 %	-14,79 %	-
	Klasse LM EUR, thesaurierend	05.02.2017	EUR	-14,84 %	-17,55 %	-14,02 %	-
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-15,53 %	-18,22 %	-16,11 %	2,90 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	-15,53 %	-18,22 %	-16,11 %	2,90 %
	Klasse GE EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-16,04 %	-18,71 %	-17,61 %	-3,09 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	-6,70 %	-11,73 %	-7,81 %	11,25 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	-6,70 %	-11,74 %	-7,81 %	11,11 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	19.02.2008	USD	-6,70 %	-11,74 %	-7,81 %	11,22 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	19.01.2017	USD	-6,69 %	-11,73 %	-7,80 %	-
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19.01.2017	AUD	-7,79 %	-12,57 %	-10,26 %	-
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	02.12.2008	EUR	-9,03 %	-13,67 %	-12,09 %	-4,41 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	28.04.2008	EUR	-9,02 %	-13,66 %	-12,10 %	-4,42 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	04/02/013	EUR	-9,05 %	-13,69 %	-12,13 %	-
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	29.05.2008	GBP	-7,59 %	-12,40 %	-9,86 %	3,88 %
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	09.07.2017	HKD	-6,25 %	-11,61 %	-7,63 %	-
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26.05.2009	SGD	-7,01 %	-11,89 %	-8,49 %	8,56 %
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	-6,93 %	-11,95 %	-8,50 %	8,37 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-7,16 %	-12,18 %	-9,19 %	5,82 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	-7,16 %	-12,18 %	-9,18 %	5,69 %

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung	
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)	Klasse A ZAR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26.04.2018	ZAR	-3,77 %	-8,75 %	2,84 %	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-7,26 %	-12,27 %	-9,46 %	4,75 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	-7,25 %	-12,26 %	-9,45 %	4,62 %	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.05.2011	EUR	-9,57 %	-14,17 %	-13,66 %	-9,95 %	
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	08.02.2013	EUR	-9,56 %	-14,17 %	-13,67 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	02/042010	USD	-6,14 %	-11,20 %	-6,13 %	18,12 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	-6,12 %	-11,20 %	-6,14 %	17,94 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	07.03.2013	USD	-6,19 %	-11,26 %	-6,24 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	27.06.2016	GBP	-7,09 %	-11,96 %	-8,39 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	09.10.2008	USD	-5,91 %	-10,98 %	-5,43 %	21,10 %	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (M)	02.06.2009	USD	-5,89 %	-10,97 %	-5,42 %	21,12 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	17.12.2009	EUR	-8,33 %	-13,00 %	-9,89 %	4,25 %	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	23.11.2012	EUR	-8,26 %	-12,95 %	-9,83 %	4,01 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	18.04.2008	GBP	-6,80 %	-11,67 %	-7,54 %	12,43 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	02.05.2013	GBP	-6,78 %	-11,65 %	-7,56 %	13,50 %	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	10.08.2015	PLN	-2,22 %	-7,59 %	-2,74 %	–	
	Klasse LM AUD, ausschüttend (M) (abgesichert)	12.03.2010	AUD	-6,69 %	-11,50 %	-6,76 %	30,77 %	
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	12.03.2010	GBP	-6,45 %	-11,34 %	-6,40 %	17,44 %	
	FTGF Western Asset US High Yield Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	-7,98 %	-13,85 %	-3,82 %	28,78 %
		Klasse A USD, ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	-7,96 %	-13,84 %	-3,83 %	28,61 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		20.12.2010	USD	-7,98 %	-13,85 %	-3,82 %	28,77 %	
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		21.11.2012	USD	-7,98 %	-13,85 %	-3,83 %	28,78 %	
Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		19.12.2012	EUR	-10,33 %	-15,78 %	-8,33 %	10,88 %	
Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		31.01.2013	SGD	-8,44 %	-14,11 %	-4,67 %	25,68 %	
Klasse B USD, ausschüttend (D)		27.02.2004	USD	-8,21 %	-14,07 %	-4,59 %	25,39 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-8,44 %	-14,27 %	-5,25 %	22,51 %	
Klasse C USD, ausschüttend (D)		27.02.2004	USD	-8,42 %	-14,27 %	-5,29 %	22,26 %	
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	-8,54 %	-14,36 %	-5,54 %	21,26 %	
Klasse E USD, ausschüttend (D)		21.01.2010	USD	-8,56 %	-14,36 %	-5,58 %	21,09 %	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		25.09.2019	EUR	-10,82 %	-16,24 %	-9,88 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		01.04.2011	USD	-7,60 %	-13,46 %	-2,22 %	36,56 %	
Klasse F USD, ausschüttend (D)		01.04.2011	USD	-7,58 %	-13,43 %	-2,43 %	48,08 %	
Klasse Premier USD, thesaurierend		11.08.2010	USD	-7,36 %	-13,24 %	-1,48 %	39,94 %	
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		08/092019	GBP	-8,14 %	-13,83 %	-3,70 %	–	
Klasse LM USD, ausschüttend (M) (abgesichert)		27.05.2008	USD	-6,94 %	-12,84 %	-0,13 %	46,40 %	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		06.12.2020	GBP	-7,96 %	-13,64 %	–	–	
Klasse A (G) USD, thesaurierend		20.04.2007	USD	-8,01 %	-13,85 %	-3,54 %	30,47 %	
Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)		20.04.2007	USD	-7,99 %	-13,84 %	-3,57 %	30,22 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,47 %	-14,28 %	-4,97 %	24,11 %		
Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,46 %	-14,28 %	-5,00 %	23,87 %		
Klasse GF USD, thesaurierend	19.11.2010	USD	-7,83 %	-13,67 %	-2,95 %	33,12 %		
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,25 %	-15,03 %	-8,91 %	15,32 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,23 %	-15,02 %	-8,78 %	15,34 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	30.01.2008	USD	-8,26 %	-15,03 %	-8,93 %	15,24 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	-8,26 %	-15,03 %	-8,92 %	15,25 %	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.06.2010	AUD	-9,56 %	-16,04 %	-11,68 %	19,27 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend	23.05.2017	EUR	-2,77 %	-9,67 %	-4,58 %	–	
	Klasse A Euro, ausschüttend (D) (abgesichert)	25.09.2012	EUR	-10,61 %	-16,95 %	-13,15 %	-0,97 %	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	-8,73 %	-15,33 %	-9,84 %	12,20 %	
	Klasse B USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,45 %	-15,21 %	-9,45 %	12,47 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-8,71 %	-15,46 %	-10,28 %	9,70 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,70 %	-15,45 %	-10,16 %	9,71 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-8,85 %	-15,58 %	-10,60 %	8,47 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	-8,84 %	-15,57 %	-10,47 %	8,45 %	
	Klasse E EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	08.02.2013	EUR	-11,27 %	-17,57 %	-14,90 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	01.04.2011	USD	-7,90 %	-14,67 %	-7,25 %	23,27 %	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	01.04.2011	USD	-7,90 %	-14,68 %	-7,13 %	23,02 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	21.03.2018	USD	-7,82 %	-14,59 %	-7,13 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	15.01.2013	GBP	-8,87 %	-15,40 %	-9,45 %	13,79 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	10.12.2012	EUR	-10,11 %	-16,44 %	-11,01 %	8,51 %	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (D) (abgesichert)	08.12.2011	GBP	-8,72 %	-15,24 %	-8,71 %	16,88 %	

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,41 %	-15,13 %	-8,76 %	16,61 %
	Klasse A (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,40 %	-15,12 %	-8,64 %	16,58 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,87 %	-15,56 %	-10,12 %	10,93 %
	Klasse L (G) USD, ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	-8,84 %	-15,53 %	-10,00 %	10,97 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Klasse A USD, thesaurierend	07.02.2008	USD	-8,27 %	-9,70 %	-6,98 %	2,71 %
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	07.02.2008	USD	-8,26 %	-9,70 %	-6,99 %	2,55 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	1. Juli 2010	USD	-8,27 %	-9,69 %	-6,97 %	2,70 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	-8,26 %	-9,69 %	-6,97 %	2,71 %
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.09.2011	AUD	-9,28 %	-10,43 %	-8,64 %	7,00 %
	Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	26.01.2015	CHF	-11,10 %	-12,04 %	-12,01 %	–
	Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	20.06.2013	CNH	-8,86 %	-9,60 %	-3,28 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	07.02.2008	EUR	-2,67 %	-3,89 %	-2,51 %	26,80 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.05.2011	EUR	-10,51 %	-11,62 %	-11,16 %	-11,91 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	04.01.2011	EUR	-2,76 %	-3,95 %	-2,50 %	24,24 %
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	27.10.2015	HKD	-7,88 %	-9,61 %	-6,90 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	19.05.2009	SGD	-8,60 %	-9,90 %	-7,55 %	-0,07 %
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	-8,62 %	-9,85 %	-7,46 %	-0,29 %
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	08.04.2010	SGD	-8,73 %	-10,21 %	-7,67 %	11,15 %
	Klasse B USD, thesaurierend	07.02.2008	USD	-8,50 %	-9,92 %	-7,67 %	0,16 %
	Klasse C USD, thesaurierend	07.02.2008	USD	-8,73 %	-10,15 %	-8,36 %	-2,30 %
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	07.02.2008	USD	-8,72 %	-10,15 %	-8,38 %	-2,44 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-8,81 %	-10,23 %	-8,63 %	-3,27 %
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	-8,81 %	-10,23 %	-8,64 %	-3,42 %
	Klasse F USD, thesaurierend	02.04.2010	USD	-7,90 %	-9,33 %	-5,85 %	6,90 %
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	-7,90 %	-9,32 %	-5,84 %	6,84 %
	Klasse X USD, ausschüttend (M)	05.07.2015	USD	-7,81 %	-9,25 %	-5,57 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	09.11.2020	EUR	-10,03 %	-11,15 %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	07.04.2008	USD	-7,67 %	-9,11 %	-5,14 %	9,60 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	9. März 2010	EUR	-2,12 %	-3,33 %	-0,63 %	34,93 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	03.12.2011	EUR	-9,89 %	-11,01 %	-9,34 %	-5,84 %
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)	01/09/ 2013	EUR	-2,14 %	-3,35 %	-0,62 %	35,03 %
	Klasse Premier EUR ausschüttend (M)	09.08.2010	EUR	-2,13 %	-3,32 %	-0,60 %	35,42 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M)	16.07.2010	GBP	3,00 %	1,80 %	4,19 %	38,59 %
	Klasse LM USD, thesaurierend	06.12.2008	USD	-7,12 %	-8,56 %	-3,41 %	16,38 %
	LM Klasse EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	27.07.2021	EUR	-9,34 %	-10,43 %	–	–
	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Klasse A USD, thesaurierend	25.06.2009	USD	-4,42 %	-6,67 %	-4,48 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		06.02.2009	USD	-4,42 %	-6,67 %	-4,48 %	3,66 %
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		30.01.2014	EUR	-6,71 %	-8,62 %	-8,60 %	–
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		23.06.2020	SEK	-6,25 %	-8,17 %	–	–
Klasse A SEK ausschüttend (M) (abgesichert)		23.06.2020	SEK	-5,88 %	-7,79 %	–	–
Klasse C USD, thesaurierend		25.06.2009	USD	-4,90 %	-7,14 %	-5,91 %	-1,41 %
Klasse C USD, ausschüttend (M)		25.06.2009	USD	-4,90 %	-7,14 %	-5,92 %	-1,42 %
Klasse E USD, thesaurierend		21.01.2010	USD	-4,99 %	-7,23 %	-6,20 %	-2,29 %
Klasse E USD, ausschüttend (D)		21.01.2010	USD	-4,99 %	-7,23 %	-6,20 %	-2,39 %
Klasse F USD, thesaurierend		02.04.2010	USD	-4,04 %	-6,30 %	-3,33 %	8,22 %
Klasse F USD, ausschüttend (D)		22.06.2020	USD	-4,04 %	-6,31 %	–	–
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		17.06.2020	EUR	-6,28 %	-8,18 %	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		06.02.2009	USD	-3,80 %	-6,06 %	-2,61 %	10,83 %
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		03.01.2019	EUR	-6,11 %	-8,02 %	-6,79 %	–
Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)		06.02.2009	EUR	-5,93 %	-8,04 %	-6,86 %	-4,43 %
Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)		06.02.2009	GBP	-4,64 %	-6,68 %	-4,29 %	3,73 %
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		06.02.2009	GBP	-4,69 %	-6,74 %	-4,34 %	3,92 %
Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus (e)		15.12.2017	USD	-3,70 %	-5,97 %	-2,31 %	–
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		15.10.2021	EUR	-6,07 %	-7,96 %	–	–
Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		12.12.2017	EUR	-6,03 %	-7,93 %	-6,55 %	–
Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		12.12.2017	GBP	-4,56 %	-6,61 %	-4,02 %	–
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		24.08.2021	AUD	-4,52 %	-6,51 %	–	–

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Klasse A USD, ausschüttend (A)	03.05.2015	USD	-10,39 %	-14,35 %	-11,01 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	17.02.2015	USD	-10,26 %	-14,21 %	-10,13 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	12.03.2010	USD	-10,10 %	-14,04 %	-9,42 %	19,44 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	27.06.2014	EUR	-12,36 %	-15,92 %	-13,53 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	12.09.2021	GBP	-10,94 %	-14,68 %	–	–
	Klasse Premier NZD thesaurierend (abgesichert)	12.12.2017	NZD	-10,56 %	-14,30 %	-10,25 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	28.03.2019	USD	-9,74 %	-13,70 %	-8,33 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	27.07.2021	EUR	-11,99 %	-15,57 %	–	–
	Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)	17.10.2018	CAD	-10,02 %	-13,91 %	-9,14 %	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	15.11.2011	USD	-10,40 %	-16,72 %	-10,31 %	14,56 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	15.11.2011	EUR	-12,69 %	-18,57 %	-14,46 %	-1,66 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	11.03.2021	EUR	-12,11 %	-18,03 %	–	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	11.03.2021	GBP	-10,78 %	-16,92 %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	27.01.2011	USD	-9,49 %	-15,88 %	-7,22 %	28,85 %
	Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)	15.01.2021	EUR	-11,78 %	-17,74 %	–	–
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	-9,72 %	-22,16 %	-18,22 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	08.01.2014	USD	-9,72 %	-22,15 %	-18,21 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	04.08.2014	USD	-9,72 %	-22,16 %	-18,22 %	–
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	16.10.2017	AUD	-11,09 %	-23,15 %	-20,83 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	27.02.2015	AUD	-11,12 %	-23,17 %	-20,87 %	–
	Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	CHF	-12,77 %	-24,38 %	-23,00 %	–
	Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	19.09.2014	CNH	-10,30 %	-22,05 %	-15,04 %	–
	Klasse A CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.03.2014	CNH	-10,32 %	-22,05 %	-15,06 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	EUR	-12,22 %	-24,09 %	-22,29 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	04.07.2015	EUR	-4,30 %	-17,22 %	-14,44 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	15.03.2019	EUR	-12,23 %	-24,10 %	-22,30 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	04.07.2016	EUR	-12,20 %	-24,07 %	-22,30 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	0,68 %	-12,86 %	-10,38 %	–
	Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	GBP	-10,86 %	-22,99 %	-21,12 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18.08.2016	GBP	-10,90 %	-23,03 %	-20,47 %	–
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	06.04.2019	HKD	-9,31 %	-22,16 %	-18,16 %	–
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (e)	07.01.2021	HKD	-9,38 %	-22,14 %	–	–
	Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	15.05.2015	SEK	-11,95 %	-23,93 %	-22,17 %	–
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	03.12.2014	SGD	-10,14 %	-22,41 %	-19,05 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	12.03.2014	SGD	-10,24 %	-22,47 %	-19,06 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (e)	02.09.2022	SGD	-10,17 %	–	–	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15.09.2014	USD	-9,95 %	-22,36 %	-18,83 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	05.05.2014	USD	-10,17 %	-22,55 %	-19,43 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	15.07.2014	USD	-10,16 %	-22,54 %	-19,43 %	–
	Klasse A JPY, ausschüttend (M) Plus (e)	17.12.2019	JPY	6,94 %	-11,18 %	-1,21 %	–
	Klasse A NOK thesaurierend (abgesichert)	21.09.2017	NOK	-11,09 %	-23,04 %	-21,20 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	13.05.2014	USD	-10,26 %	-22,62 %	-19,67 %	–
	Klasse E USD, ausschüttend (S)	28.07.2014	USD	-10,26 %	-22,62 %	-19,68 %	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	25.08.2014	EUR	-12,73 %	-24,53 %	-23,67 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	18.06.2014	USD	-9,36 %	-21,85 %	-17,23 %	–
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	16.10.2014	USD	-9,35 %	-21,85 %	-17,23 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	03.05.2014	USD	-9,27 %	-21,77 %	-16,97 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	26.10.2015	USD	-9,28 %	-21,76 %	-16,97 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	02.03.2015	USD	-9,27 %	-21,77 %	-16,97 %	–
	Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	03.05.2014	CHF	-12,32 %	-23,97 %	-21,80 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	29.07.2014	EUR	-3,68 %	-16,69 %	-12,88 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	EUR	-11,84 %	-23,76 %	-21,17 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung	
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse X EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	08.11.2016	EUR	-11,74 %	-23,69 %	-21,09 %	–	
	Klasse X Euro, ausschüttend (M) (abgesichert)	17.05.2016	EUR	-11,77 %	-23,71 %	-21,11 %	–	
	Klasse X GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	1,20 %	-12,39 %	-9,04 %	–	
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	14.02.2014	GBP	-10,42 %	-22,61 %	-19,25 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	20.10.2015	GBP	-10,47 %	-22,66 %	-19,26 %	–	
	Klasse X SGD thesaurierend (abgesichert)	03.10.2014	SGD	-9,75 %	-22,07 %	-17,87 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	-9,11 %	-21,64 %	-16,60 %	–	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	02.10.2015	USD	-9,13 %	-21,65 %	-16,61 %	–	
	Klasse Premier AUD, thesaurierend (abgesichert)	07.03.2017	AUD	-10,51 %	-22,65 %	-19,29 %	–	
	Klasse Premier AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	24.07.2015	AUD	-10,52 %	-22,65 %	-19,36 %	–	
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	22.12.2015	BRL	-1,75 %	-15,13 %	-8,11 %	–	
	Klasse Premier CHF, thesaurierend (abgesichert)	12.04.2014	CHF	-12,22 %	-23,91 %	-21,51 %	–	
	Klasse Premier CHF, ausschüttend (S) (abgesichert)	27.11.2015	CHF	-12,19 %	-23,87 %	-21,49 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	07.03.2014	EUR	-3,65 %	-16,65 %	-12,63 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	26.03.2014	EUR	-11,64 %	-23,59 %	-20,74 %	–	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (S) (abgesichert)	27.11.2015	EUR	-11,63 %	-23,60 %	-20,78 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	12.01.2014	GBP	-10,31 %	-22,51 %	-18,91 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21.05.2014	GBP	-10,33 %	-22,53 %	-18,92 %	–	
	Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	12.01.2016	JPY	-12,08 %	-23,54 %	-20,01 %	–	
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	21.07.2017	PLN	-5,88 %	-18,98 %	-14,72 %	–	
	Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	15.05.2015	SEK	-11,38 %	-23,43 %	-20,69 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	29.11.2013	USD	-8,76 %	-21,33 %	-15,60 %	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	29.11.2013	EUR	-11,27 %	-23,27 %	-19,79 %	–	
	Klasse LM AUD, ausschüttend (S) (abgesichert)	08.09.2016	AUD	-9,62 %	-21,87 %	-16,82 %	–	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	04.05.2016	EUR	-2,68 %	-15,82 %	-9,96 %	–	
	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	08.11.2016	USD	-8,21 %	-13,48 %	-9,51 %	–
		Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	16.12.2015	USD	-8,22 %	-13,48 %	-8,95 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		23.01.2017	EUR	-10,49 %	-15,36 %	-13,61 %	–	
Klasse C USD, thesaurierend		08/11/ 2016	USD	-8,37 %	-13,63 %	-9,83 %	–	
Klasse X CHF, ausschüttend (M) (abgesichert)		22.02.2017	CHF	-10,52 %	-15,21 %	-12,88 %	–	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)		12.06.2019	GBP	-8,40 %	-13,48 %	-9,27 %	–	
Klasse S USD, thesaurierend		15.01.2021	USD	-7,30 %	-12,63 %	–	–	
Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)		18.11.2019	EUR	-9,58 %	-14,49 %	-10,96 %	–	
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)		20.11.2019	GBP	-8,20 %	-13,30 %	-8,71 %	–	
Klasse LM EUR, thesaurierend (abgesichert)		25.07.2019	EUR	-9,27 %	-14,19 %	-9,93 %	–	
Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)		16.12.2015	GBP	-7,83 %	-12,95 %	-7,60 %	–	
Klasse LM CAD, thesaurierend (abgesichert)		28.02.2022	CAD	-7,24 %	–	–	–	
Klasse S CHF ausschüttend (A)		26.11.2021	CHF	-4,80 %	-11,33 %	–	–	
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]		Klasse D EUR, thesaurierend (abgesichert)	23.05.2018	EUR	-7,41 %	-10,57 %	-14,49 %	–
	Klasse D EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	13.06.2018	EUR	-7,52 %	-10,58 %	-14,47 %	–	
	Klasse D USD, thesaurierend	24.01.2018	USD	-5,32 %	-8,78 %	-10,84 %	–	
	Klasse D USD, ausschüttend (M)	14.02.2018	USD	-5,32 %	-8,79 %	-10,84 %	–	
	Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus	30.05.2018	USD	-5,33 %	-8,79 %	-10,84 %	–	
	Klasse M CHF, thesaurierend (abgesichert)	30.05.2018	CHF	-7,45 %	-10,38 %	-13,75 %	–	
	Klasse M USD, ausschüttend (M) (abgesichert)	28.11.2018	USD	-4,76 %	-8,24 %	-9,22 %	–	
	Klasse M EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2018	EUR	-6,89 %	-10,02 %	-12,89 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	05.04.2016	USD	-4,61 %	-8,10 %	-8,81 %	–	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (Q)	13.12.2017	USD	-4,61 %	-8,10 %	-8,80 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	05.04.2016	EUR	-6,82 %	-9,95 %	-12,56 %	–	
	Klasse Premier EUR ausschüttend (Q) (abgesichert)	27.12.2017	EUR	-6,73 %	-9,86 %	-12,50 %	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18.04.2018	GBP	-5,26 %	-8,52 %	-9,24 %	–
	Klasse Premier JPY, thesaurierend (abgesichert)	04.01.2020	JPY	-7,31 %	-10,03 %	–	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	13.01.2016	USD	-4,03 %	-7,55 %	-7,15 %	–
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	13.01.2016	USD	-10,73 %	-13,00 %	-13,15 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	13.01.2016	USD	-9,69 %	-11,99 %	-10,07 %	–
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	Klasse A GBP, thesaurierend	17.11.2016	GBP	-13,13 %	-18,72 %	-15,42 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	11.03.2021	GBP	-12,88 %	-18,50 %	–	–
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	17.11.2016	USD	-12,06 %	-17,63 %	-9,98 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	14.06.2019	USD	-11,46 %	-17,09 %	-8,17 %	–
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]	Klasse LM USD, ausschüttend (Q)	01.11.2021	USD	-15,14 %	-22,44 %	–	–
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	01.10.2022	USD	-10,53 %	–	–	–
	Klasse F USD, thesaurierend	01.10.2022	USD	-10,16 %	–	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	01.10.2022	USD	-9,94 %	–	–	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	01.10.2022	BRL	-2,13 %	–	–	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	01.10.2022	EUR	-12,20 %	–	–	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	01.10.2022	GBP	-10,87 %	–	–	–
	Klasse S USD, thesaurierend	01.10.2022	USD	-9,85 %	–	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	01.10.2022	EUR	-12,11 %	–	–	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	-14,96 %	-16,48 %	-19,20 %	-16,78 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	12.07.2010	USD	-14,96 %	-16,48 %	-19,21 %	-16,78 %
	Klasse A USD, ausschüttend (S)	10.01.2003	USD	-14,97 %	-16,48 %	-19,20 %	-16,78 %
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.07.2014	AUD	-16,55 %	-17,77 %	-22,31 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.02.2013	EUR	-17,56 %	-18,76 %	-23,71 %	-30,42 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	18.01.2008	EUR	-11,34 %	-13,17 %	-16,97 %	-7,62 %
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	06.07.2013	EUR	-17,57 %	-18,78 %	-23,77 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S)	14.10.2016	EUR	-9,88 %	-11,18 %	-15,38 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	22.11.2010	EUR	-11,31 %	-13,13 %	-16,95 %	-7,54 %
	Klasse A GBP, thesaurierend	22.06.2018	GBP	-5,16 %	-6,49 %	-11,48 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	14.11.2014	GBP	-16,54 %	-17,85 %	-22,20 %	–
	Klasse A GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	02.07.2008	GBP	-9,89 %	-11,86 %	-15,04 %	-1,23 %
	Klasse A SGD, thesaurierend	06.08.2015	SGD	-15,45 %	-16,95 %	-20,32 %	–
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-15,17 %	-16,68 %	-19,81 %	-18,82 %
	Klasse B USD, ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	-15,17 %	-16,69 %	-19,85 %	-18,86 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-15,38 %	-16,90 %	-20,42 %	-20,84 %
	Klasse C USD, ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	-15,38 %	-16,89 %	-20,41 %	-20,84 %
	Klasse E USD, thesaurierend	09.08.2011	USD	-15,47 %	-16,98 %	-20,65 %	-21,62 %
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	13.07.2012	EUR	-11,89 %	-13,69 %	-18,45 %	-13,09 %
	Klasse F USD, thesaurierend	14.09.2012	USD	-14,60 %	-16,14 %	-18,23 %	-13,39 %
	Klasse F USD, ausschüttend (S)	10.04.2012	USD	-14,61 %	-16,14 %	-18,23 %	-13,38 %
	Klasse R GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	05.02.2013	GBP	-9,52 %	-11,48 %	-13,84 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	06.04.2013	USD	-14,53 %	-16,06 %	-17,99 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (S)	26.03.2013	USD	-14,54 %	-16,07 %	-17,99 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	28.06.2013	EUR	-17,13 %	-18,35 %	-22,53 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.08.2015	EUR	-10,91 %	-12,74 %	-15,73 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	12.11.2017	EUR	-11,23 %	-12,67 %	-15,72 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	23.12.2014	GBP	-4,76 %	-6,07 %	-10,26 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	10.10.2014	GBP	-16,27 %	-17,57 %	-21,13 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	19.08.2015	GBP	-9,55 %	-11,52 %	-13,94 %	–
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert)	25.02.2013	GBP	-16,16 %	-17,50 %	-21,12 %	-21,23 %	
Klasse X GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	15.07.2014	GBP	-9,43 %	-11,41 %	-13,79 %	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend	24.03.2011	USD	-14,40 %	-15,93 %	-17,62 %	-11,19 %	
Klasse Premier USD, ausschüttend (S)	24.02.2012	USD	-14,39 %	-15,92 %	-17,60 %	-11,17 %	
Klasse Premier EUR, thesaurierend	25.01.2011	EUR	-9,27 %	-10,59 %	-13,79 %	8,87 %	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.01.2013	EUR	-17,00 %	-18,21 %	-22,22 %	-25,82 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert) (IH)	11.04.2011	EUR	-10,77 %	-12,60 %	-15,43 %	-1,33 %	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	15.09.2021	GBP	-16,07 %	-17,42 %	–	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)	10.10.2014	GBP	-16,02 %	-17,32 %	-20,70 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (S) (abgesichert) (IH)	14.08.2012	GBP	-9,30 %	-11,28 %	-13,55 %	5,31 %	
	Klasse LM USD, thesaurierend	28.03.2019	USD	-13,89 %	-15,42 %	-16,11 %	–	
	Klasse LM USD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	25.11.2015	USD	-7,88 %	-10,03 %	-9,73 %	–	
	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	04.03.2012	USD	-4,36 %	-4,92 %	-0,07 %	3,95 %
Klasse A USD, ausschüttend (A)		17.09.2013	USD	-4,38 %	-4,93 %	-0,01 %	–	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		18.06.2013	EUR	-6,93 %	-7,15 %	-4,91 %	–	
Klasse C USD, thesaurierend		17.07.2013	USD	-4,85 %	-5,41 %	-1,59 %	–	
Klasse E USD, thesaurierend		17.07.2013	USD	-4,95 %	-5,50 %	-1,88 %	–	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		27.08.2013	USD	-4,94 %	-5,50 %	-1,86 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		29.07.2014	USD	-3,99 %	-4,55 %	1,11 %	–	
Klasse X USD thesaurierend		16.03.2018	USD	-3,94 %	-4,50 %	1,27 %	–	
Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)		16.06.2014	GBP	-5,05 %	-5,38 %	-1,10 %	–	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		21.01.2014	GBP	-5,04 %	-5,37 %	-0,98 %	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		25.03.2013	USD	-3,80 %	-4,36 %	1,72 %	–	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		13.05.2014	USD	-3,79 %	-4,36 %	1,61 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		07.02.2012	EUR	-6,32 %	-6,53 %	-3,07 %	-5,30 %	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		23.05.2013	EUR	-6,31 %	-6,52 %	-3,11 %	–	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		25.03.2013	GBP	-4,91 %	-5,23 %	-0,57 %	–	
Klasse LM USD, thesaurierend		06.12.2014	USD	-2,93 %	-3,49 %	4,50 %	–	
Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)		04.03.2012	AUD	-4,23 %	-4,47 %	1,98 %	25,26 %	
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]		Klasse A USD, thesaurierend	14.10.2016	USD	-5,94 %	-12,58 %	-3,90 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	18.07.2016	USD	-5,94 %	-12,58 %	-3,97 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	30.11.2012	USD	-5,27 %	-11,91 %	-1,83 %	37,64 %	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert) (IH)	30.11.2012	GBP	-4,61 %	-11,17 %	-2,69 %	35,51 %	
	Klasse S CAD, thesaurierend (abgesichert) (IH)	23.02.2016	CAD	-3,92 %	-10,64 %	-1,08 %	–	
	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.06.2011	USD	-15,91 %	-17,30 %	-14,96 %	-8,89 %
Klasse A USD, ausschüttend (M)		25.06.2010	USD	-15,91 %	-17,30 %	-14,97 %	-8,91 %	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		04.04.2018	EUR	-18,46 %	-19,44 %	-19,67 %	–	
Klasse A SGD, thesaurierend		17.04.2020	SGD	-16,43 %	-17,89 %	–	–	
Klasse C USD, thesaurierend		21.03.2012	USD	-16,33 %	-17,72 %	-16,22 %	-13,37 %	
Klasse E USD, thesaurierend		17.02.2012	USD	-16,41 %	-17,80 %	-16,47 %	-14,22 %	
Klasse F USD, thesaurierend		22.07.2014	USD	-15,57 %	-16,96 %	-13,93 %	–	
Klasse F USD, ausschüttend (M)		19.07.2013	USD	-15,57 %	-16,98 %	-13,93 %	–	
Klasse X USD thesaurierend		05.03.2016	USD	-15,48 %	-16,89 %	-13,67 %	–	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert)		10.10.2014	GBP	-17,29 %	-18,43 %	-17,11 %	–	
Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) (IH)		27.05.2020	GBP	-10,54 %	-12,40 %	–	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		01.06.2012	USD	-15,37 %	-16,76 %	-13,28 %	-2,81 %	
Klasse Premier GBP, ausschüttend (abgesichert) (IH)		24.06.2016	GBP	-10,41 %	-12,27 %	-8,98 %	–	
Premier Klasse NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		19.09.2012	NZD	-10,09 %	-11,92 %	-8,46 %	33,09 %	
Klasse LM EUR, thesaurierend		04.05.2016	EUR	-9,70 %	-10,91 %	-7,39 %	–	
Klasse LM NZD, thesaurierend (abgesichert) (IH)		13.01.2012	NZD	-9,51 %	-11,35 %	-6,75 %	41,76 %	
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		Klasse A USD, thesaurierend	30.08.2013	USD	-10,82 %	-14,59 %	-2,22 %	–
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	26.08.2020	USD	-10,83 %	-14,59 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (D)	28.08.2020	USD	-10,82 %	-14,60 %	–	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	15.01.2021	USD	-10,83 %	-14,59 %	–	–	
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	06.03.2013	USD	-10,82 %	-14,60 %	-2,21 %	–	
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	23.06.2021	AUD	-12,19 %	-15,65 %	–	–	
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	AUD	-12,17 %	-15,62 %	–	–	
	Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15.04.2021	CNH	-11,51 %	-14,59 %	–	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend	25.11.2020	EUR	-5,31 %	-9,02 %	–	–	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	22.08.2016	EUR	-13,40 %	-16,74 %	-7,24 %	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	19.05.2015	EUR	-13,40 %	-16,75 %	-7,38 %	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	EUR	-13,39 %	-16,77 %	–	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	21.10.2013	EUR	-13,38 %	-16,76 %	-7,29 %	–	
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	30.08.2021	GBP	-12,15 %	-15,72 %	–	–	
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	24.10.2013	GBP	-12,13 %	-15,70 %	-4,95 %	–	
	Klasse A HKD, thesaurierend	30.08.2021	HKD	-10,43 %	-14,51 %	–	–	
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	04.09.2021	HKD	-10,44 %	-14,52 %	–	–	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21.10.2015	SGD	-11,25 %	-14,90 %	-3,22 %	–	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	17.02.2021	SGD	-11,30 %	-14,90 %	–	–	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus	29.01.2021	SGD	-11,32 %	-15,22 %	–	–	
	Klasse C USD, thesaurierend	23.09.2020	USD	-11,26 %	-15,02 %	–	–	
	Klasse C USD, ausschüttend (D)	24.11.2020	USD	-11,25 %	-15,01 %	–	–	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.04.2020	USD	-11,36 %	-15,10 %	–	–	
	Klasse E USD, ausschüttend (D)	22.01.2021	USD	-11,33 %	-15,10 %	–	–	
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.03.2017	EUR	-13,93 %	-17,26 %	-8,83 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	22.10.2020	USD	-10,42 %	-14,20 %	–	–	
	Klasse F USD, ausschüttend (D)	24.07.2019	USD	-10,41 %	-14,20 %	-0,91 %	–	
	Klasse X USD thesaurierend	25.09.2020	USD	-10,31 %	-14,11 %	–	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (D)	18.07.2017	USD	-10,58 %	-14,41 %	-1,01 %	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	21.01.2014	USD	-10,30 %	-14,11 %	-0,54 %	–	
	Klasse X CHF, thesaurierend (abgesichert)	16.07.2021	CHF	-13,36 %	-16,61 %	–	–	
	Klasse X CHF, ausschüttend (A) (abgesichert)	22.02.2021	CHF	-13,31 %	-16,56 %	–	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	17.02.2021	EUR	-4,92 %	-8,64 %	–	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	16.02.2021	EUR	-12,93 %	-16,31 %	–	–	
	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.12.2013	EUR	-12,88 %	-16,29 %	-5,73 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	20.12.2013	GBP	-11,63 %	-15,24 %	-3,42 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	10.09.2020	USD	-10,17 %	-13,99 %	–	–	
	Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus (e)	06.03.2013	USD	-10,17 %	-13,99 %	-0,13 %	–	
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	09.10.2021	BRL	-2,53 %	-6,33 %	–	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	10. Juli 2014	EUR	-12,77 %	-16,15 %	-5,18 %	–	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13.12.2013	EUR	-12,73 %	-16,14 %	-5,29 %	–	
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	23.10.2014	GBP	-11,45 %	-15,04 %	-2,90 %	–	
	Klasse Premier SEK, thesaurierend (abgesichert)	22.10.2014	SEK	-12,64 %	-16,07 %	-4,86 %	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	07.06.2020	USD	-10,01 %	-13,82 %	–	–	
	Klasse S USD, ausschüttend (Q) Plus (e)	14.09.2021	USD	-10,01 %	-13,82 %	–	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.10.2018	EUR	-12,64 %	-16,01 %	-4,75 %	–	
	Klasse S EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	18.09.2018	EUR	-12,59 %	-16,01 %	-4,81 %	–	
	Klasse S GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	02.01.2018	GBP	-11,42 %	-14,99 %	-2,46 %	–	
	Klasse LM USD, ausschüttend (M)	30.09.2021	USD	-9,70 %	-13,51 %	–	–	
	LM Klasse EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	08.11.2021	EUR	-12,30 %	-15,68 %	–	–	
	Klasse LM GBP, thesaurierend (abgesichert)	10.08.2020	GBP	-11,05 %	-14,65 %	–	–	
	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	30.06.2014	USD	-1,42 %	-0,85 %	-0,34 %	–
		Klasse X USD, ausschüttend (M)	30.04.2021	USD	-0,58 %	0,04 %	–	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		30.06.2014	USD	-0,77 %	-0,21 %	1,61 %	–	
Klasse LM USD, thesaurierend		30.06.2014	USD	0,38 %	0,95 %	5,20 %	–	
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^]	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	04.06.2017	USD	-7,43 %	-13,92 %	-5,28 %	–	
	Klasse S EUR, ausschüttend (A) (abgesichert) (IH)	04.06.2017	EUR	-7,17 %	-13,37 %	-5,29 %	–	
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	16.08.2018	USD	-10,85 %	-13,09 %	-21,99 %	–	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	16.09.2019	SGD	-11,64 %	-13,73 %	-23,72 %	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	16.08.2018	GBP	-12,07 %	-14,08 %	-23,51 %	–	
	Klasse LM AUD, thesaurierend (abgesichert)	16.08.2018	AUD	-10,99 %	-12,94 %	-21,03 %	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	31.12.2015	USD	(2,39) %	(7,57) %	28,13 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	31.12.2015	USD	(1,46) %	(6,69) %	31,83 %	–	
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	12.09.2021	GBP	9,90 %	4,47 %	–	–	
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.12.2015	EUR	(4,52) %	(9,34) %	25,34 %	–	
FTGF ClearBridge Value Fund	Klasse A USD, thesaurierend	24.04.2007	USD	-2,64 %	-8,00 %	28,83 %	146,07 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	23.03.1998	USD	-2,65 %	-8,00 %	28,83 %	146,03 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend	06.12.2007	EUR	3,25 %	-2,12 %	34,85 %	202,05 %	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	09.02.2014	EUR	-6,30 %	-11,19 %	20,87 %	–	
	Klasse A GBP, ausschüttend (A)	28.08.2014	GBP	8,58 %	2,88 %	40,46 %	–	
	Klasse A SGD, thesaurierend	18.05.2007	SGD	-3,16 %	-8,57 %	28,13 %	167,13 %	
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	09.10.2012	SGD	-3,73 %	-8,88 %	25,67 %	134,44 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-3,14 %	-8,46 %	26,90 %	134,06 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	-3,13 %	-8,46 %	26,91 %	134,04 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	26.03.2021	USD	-3,37 %	-8,69 %	–	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-2,06 %	-7,44 %	31,17 %	162,91 %	
	Klasse F USD ausschüttend (A)	19.10.2016	USD	-2,07 %	-7,44 %	31,17 %	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	10.07.2013	USD	-1,98 %	-7,37 %	31,47 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	22.02.2021	EUR	3,97 %	-1,43 %	–	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	07.01.2008	USD	-1,64 %	-7,05 %	32,85 %	172,59 %	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	25.04.2014	USD	-1,64 %	-7,05 %	32,85 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	30.06.2014	EUR	4,27 %	-1,15 %	38,62 %	–	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.08.2021	EUR	-5,40 %	-10,28 %	–	–	
	LM Klasse USD, ausschüttend (A)	21.07.2021	USD	-0,98 %	-6,42 %	–	–	
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,26 %	-16,05 %	15,21 %	136,75 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-8,26 %	-16,05 %	15,21 %	136,78 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend	06.03.2008	EUR	-2,78 %	-10,73 %	20,76 %	192,26 %	
	Klasse B USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-8,72 %	-16,47 %	13,50 %	125,32 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-8,72 %	-16,47 %	13,49 %	125,21 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-8,72 %	-16,47 %	13,50 %	125,22 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-8,95 %	-16,67 %	12,65 %	119,62 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	21.01.2010	USD	-8,97 %	-16,69 %	12,63 %	119,58 %	
	Klasse F USD, thesaurierend	17.09.2012	USD	-7,73 %	-15,55 %	17,29 %	151,31 %	
	Klasse F USD ausschüttend (A)	02.04.2010	USD	-7,73 %	-15,55 %	17,29 %	151,29 %	
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	10.07.2013	USD	-7,71 %	-15,53 %	17,38 %	–	
	Klasse X EUR, thesaurierend	10.07.2013	EUR	-2,15 %	-10,15 %	23,06 %	–	
	Klasse Premier USD, thesaurierend	05.06.2010	USD	-7,38 %	-15,23 %	18,62 %	160,95 %	
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	04.09.2009	USD	-7,38 %	-15,23 %	18,62 %	160,88 %	
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	06.07.2010	EUR	-1,75 %	-9,80 %	24,19 %	221,90 %	
	Klasse LM USD, thesaurierend	04.05.2016	USD	-6,80 %	-14,70 %	20,86 %	–	
	Klasse LM EUR, thesaurierend	04.05.2016	EUR	-1,19 %	-9,27 %	26,64 %	–	
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-7,96 %	-15,76 %	16,42 %	145,10 %	
	Klasse B (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,46 %	-16,22 %	14,50 %	132,68 %	
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-8,42 %	-16,18 %	14,68 %	133,15 %	
	Klasse GA USD, thesaurierend	06.10.2011	USD	-8,11 %	-15,91 %	15,82 %	140,95 %	
	Klasse GA EUR, thesaurierend	06.10.2011	EUR	-2,59 %	-10,56 %	21,36 %	197,68 %	
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	06.10.2011	EUR	-2,59 %	-10,56 %	21,40 %	197,38 %	
	Klasse GE USD, thesaurierend	06.10.2011	USD	-8,80 %	-16,53 %	13,24 %	123,56 %	
	Klasse GE EUR, thesaurierend	06.10.2011	EUR	-3,34 %	-11,24 %	18,66 %	176,47 %	
	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-15,39 %	-32,88 %	5,94 %	196,31 %
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-15,39 %	-32,88 %	5,94 %	196,36 %
Klasse A EUR, thesaurierend		27.08.2008	EUR	-10,32 %	-28,62 %	10,98 %	264,20 %	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		02.05.2016	EUR	-18,58 %	-35,23 %	-0,31 %	–	
Klasse B USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-15,82 %	-33,21 %	4,35 %	181,86 %	
Klasse B USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	-15,82 %	-33,21 %	4,36 %	181,88 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-15,82 %	-33,21 %	4,36 %	181,88 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		20.04.2007	USD	-15,82 %	-33,21 %	4,36 %	181,86 %	
Klasse E USD, thesaurierend		14.01.2016	USD	-16,03 %	-33,38 %	3,57 %	–	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		13.10.2015	USD	-16,03 %	-33,38 %	3,57 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		19.04.2016	USD	-14,88 %	-32,47 %	7,87 %	–	
Klasse F USD ausschüttend (A)		11.08.2015	USD	-14,89 %	-32,47 %	7,86 %	–	
Klasse U USD, thesaurierend		03.02.2018	USD	-14,48 %	-32,15 %	9,41 %	–	
Klasse U EUR, thesaurierend		03.02.2018	EUR	-9,36 %	-27,83 %	14,70 %	–	
Klasse X USD thesaurierend		29.09.2015	USD	-14,86 %	-32,46 %	7,95 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend		17.01.2018	EUR	-9,75 %	-28,28 %	12,82 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		27.07.2016	EUR	-18,17 %	-34,90 %	1,48 %	–	
Klasse X GBP, thesaurierend		12.04.2015	GBP	-5,04 %	-24,36 %	18,22 %	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		19.09.2014	USD	-14,56 %	-32,22 %	9,08 %	–	
Klasse Premier USD, ausschüttend (A)		21.02.2020	USD	-14,56 %	-32,22 %	–	–	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		15.02.2018	BRL	-8,62 %	-27,29 %	17,19 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend		15.09.2016	EUR	-9,46 %	-27,93 %	14,28 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)		03.02.2016	EUR	-17,84 %	-34,64 %	2,57 %	–	
Klasse Premier EUR, ausschüttend (A)		21.02.2020	EUR	-9,41 %	-27,89 %	–	–	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier GBP, thesaurierend	12.02.2015	GBP	-4,68 %	-24,09 %	19,20 %	–
	Klasse LM USD, thesaurierend	04.05.2016	USD	-14,03 %	-31,79 %	11,15 %	–
	Klasse LM EUR, thesaurierend	04.05.2016	EUR	-8,84 %	-27,44 %	16,48 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-15,10 %	-32,64 %	7,06 %	206,72 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-15,52 %	-32,98 %	5,46 %	191,77 %
	Klasse GA USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-15,24 %	-32,76 %	6,51 %	201,57 %
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-10,15 %	-28,48 %	11,63 %	272,40 %
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Klasse A USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-14,95 %	-27,82 %	-11,01 %	72,10 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-14,95 %	-27,82 %	-11,01 %	72,17 %
	Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	06.03.2013	AUD	-17,68 %	-29,86 %	-17,21 %	–
	Klasse A CHF thesaurierend (abgesichert)	23.10.2014	CHF	-18,32 %	-30,30 %	-16,53 %	–
	Klasse A CNH thesaurierend (abgesichert)	14.11.2014	CNH	-16,15 %	-28,22 %	-8,75 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	09.07.2010	EUR	-9,85 %	-23,24 %	-6,82 %	111,88 %
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	04.02.2013	EUR	-18,16 %	-30,28 %	-16,26 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)	28.08.2014	EUR	-18,14 %	-30,26 %	-16,22 %	–
	Klasse A GBP, thesaurierend	29.09.2014	GBP	-5,13 %	-19,18 %	-2,51 %	–
	Klasse A HKD, thesaurierend	27.10.2015	HKD	-14,57 %	-27,75 %	-10,93 %	–
	Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SEK	-18,36 %	-30,51 %	-18,08 %	41,43 %
	Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SGD	-15,96 %	-28,48 %	-13,11 %	63,64 %
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-15,37 %	-28,18 %	-12,33 %	63,73 %
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-15,37 %	-28,18 %	-12,33 %	63,73 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	-15,37 %	-28,18 %	-12,33 %	63,72 %
	Klasse E USD, thesaurierend	01.04.2011	USD	-15,59 %	-28,37 %	-12,99 %	59,66 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	01.04.2011	USD	-15,58 %	-28,36 %	-12,99 %	59,67 %
	Klasse E EUR, thesaurierend	16.03.2021	EUR	-10,53 %	-23,83 %	–	–
	Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)	09.10.2013	EUR	-18,78 %	-30,80 %	-18,14 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	01.04.2011	USD	-14,43 %	-27,39 %	-9,39 %	82,76 %
	Klasse F USD ausschüttend (A)	01.04.2011	USD	-14,43 %	-27,39 %	-9,38 %	82,88 %
	Klasse X USD, thesaurierend	17.05.2013	USD	-14,39 %	-27,35 %	-9,25 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	13.02.2013	USD	-14,39 %	-27,35 %	-9,25 %	83,65 %
	Klasse X EUR, thesaurierend	21.01.2014	EUR	-9,25 %	-22,73 %	-4,90 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	19.02.2014	EUR	-17,63 %	-29,82 %	-14,62 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	24.04.2013	GBP	-4,53 %	-18,66 %	-0,63 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	17.03.2010	USD	-14,09 %	-27,10 %	-8,30 %	90,18 %
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	14.12.2010	EUR	-8,91 %	-22,46 %	-3,93 %	134,06 %
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	27.02.2017	GBP	-4,24 %	-18,43 %	0,29 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	22.04.2014	GBP	-16,34 %	-28,84 %	-12,79 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	13.12.2012	GBP	-4,21 %	-18,39 %	0,42 %	139,14 %
	Klasse LM EUR, thesaurierend	04.05.2016	EUR	-8,34 %	-21,96 %	-2,04 %	–
Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-14,65 %	-27,57 %	-10,06 %	78,24 %	
Klasse B (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-15,07 %	-27,93 %	-11,40 %	69,60 %	
Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	-15,08 %	-27,93 %	-11,41 %	69,53 %	
Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-9,63 %	-23,06 %	-6,10 %	117,18 %	
Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	-9,63 %	-23,06 %	-6,10 %	117,06 %	
Klasse GE USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-15,39 %	-28,20 %	-12,38 %	63,39 %	
Klasse GE EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-10,31 %	-23,63 %	-8,19 %	101,66 %	
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	13.08.2013	USD	-9,33 %	-15,59 %	4,49 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	-9,33 %	-15,58 %	4,48 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus	19.06.2014	USD	-9,33 %	-15,58 %	4,49 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–
	Plus (e)	06.03.2013	USD	-9,33 %	-15,59 %	4,49 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	05.08.2015	USD	-9,33 %	-15,58 %	4,49 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	25.06.2014	AUD	-11,84 %	-17,64 %	-2,28 %	–
	Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.07.2014	CNH	-10,31 %	-15,81 %	7,51 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	27.03.2015	EUR	-3,88 %	-10,22 %	9,48 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	21.11.2014	EUR	-12,40 %	-18,18 %	-1,51 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	27.02.2014	EUR	-12,35 %	-18,14 %	-1,47 %	–
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	28.07.2014	HKD	-8,98 %	-15,53 %	4,52 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	28.07.2014	SGD	-10,23 %	-16,25 %	2,26 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	27.09.2013	USD	-9,78 %	-16,00 %	2,93 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	-9,78 %	-16,01 %	2,92 %	–
	Klasse C USD, ausschüttend (Q)	29.08.2014	USD	-9,78 %	-16,01 %	2,93 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	27.03.2015	USD	-8,78 %	-15,07 %	6,39 %	–
	Klasse F EUR, thesaurierend	27.03.2015	EUR	-3,31 %	-9,67 %	11,48 %	–
	Klasse F EUR, ausschüttend (A)	27.03.2015	EUR	-3,30 %	-9,68 %	11,47 %	–
	Klasse X EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	24.04.2017	EUR	-11,88 %	-17,69 %	0,32 %	–

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	03.11.2020	USD	-9,28 %	-22,37 %	–	–
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	-9,28 %	-22,37 %	24,08 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	28.02.2022	EUR	-3,73 %	–	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	-12,67 %	-25,02 %	16,68 %	–
	Klasse A SEK, thesaurierend	21.01.2020	SEK	0,40 %	-10,23 %	–	–
	Klasse F USD, thesaurierend	03.11.2020	USD	-8,73 %	-21,90 %	–	–
	Klasse X USD thesaurierend	30.07.2020	USD	-8,73 %	-21,91 %	–	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	-8,73 %	-21,90 %	26,34 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	24.03.2021	EUR	-3,19 %	-16,84 %	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	-12,02 %	-24,44 %	18,94 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	22.12.2015	GBP	1,71 %	-12,65 %	38,23 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	18.12.2019	GBP	-10,84 %	-23,59 %	20,42 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24.06.2020	USD	-8,41 %	-21,63 %	–	–
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	-8,41 %	-21,63 %	27,73 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	30.09.2015	EUR	-11,69 %	-24,19 %	20,26 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30.09.2015	GBP	2,07 %	-12,32 %	39,89 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	07.11.2018	USD	-8,23 %	-21,47 %	28,70 %	–
	Klasse S EUR, thesaurierend	13.07.2020	EUR	-2,71 %	-16,48 %	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	13.07.2020	EUR	-11,50 %	-24,02 %	–	–
	Klasse S GBP, thesaurierend	31.07.2019	GBP	2,34 %	-12,10 %	40,85 %	–
Klasse S GBP, thesaurierend (abgesichert)	19.11.2019	GBP	-10,35 %	-23,16 %	22,74 %	–	
Klasse S GBP, ausschüttend (Q)	31.07.2019	GBP	2,41 %	-12,04 %	40,85 %	–	
Klasse LM EUR, thesaurierend	21.05.2021	EUR	-2,35 %	-16,18 %	–	–	
FTGF ClearBridge Global Growth Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	29.06.2018	USD	-9,08 %	-23,50 %	12,09 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	29.06.2018	USD	-8,17 %	-22,73 %	15,51 %	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	11.10.2017	USD	-3,27 %	-5,22 %	8,34 %	–
	Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	16.03.2017	USD	5,08 %	2,93 %	18,60 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	19.06.2017	USD	4,97 %	2,90 %	18,51 %	–
	Klasse A USD, ausschüttend (Q)	12.12.2016	USD	-3,24 %	-5,17 %	8,95 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24.10.2019	AUD	2,94 %	1,23 %	12,98 %	–
	Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	24.10.2019	CNH	4,47 %	3,03 %	22,95 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	12.12.2016	EUR	2,66 %	0,91 %	14,24 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert) (PH)	12.03.2019	EUR	-0,95 %	-2,94 %	10,72 %	–
	Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus	22.10.2018	EUR	2,66 %	0,89 %	14,15 %	–
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	06.05.2017	SGD	4,44 %	2,58 %	16,98 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	26.09.2017	USD	-3,64 %	-5,66 %	7,25 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend (abgesichert)	26.09.2017	USD	4,47 %	2,29 %	16,65 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	12.12.2016	USD	-3,83 %	-5,80 %	6,40 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	04.12.2021	USD	4,26 %	2,08 %	–	–
	Klasse F USD, thesaurierend	08.10.2017	USD	-2,66 %	-4,68 %	10,80 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend (abgesichert)	26.09.2017	USD	5,65 %	3,49 %	20,64 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	20.03.2019	USD	-2,33 %	-4,26 %	11,86 %	–
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	17.05.2017	USD	-2,23 %	-4,20 %	12,11 %	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	24.10.2018	EUR	3,55 %	1,81 %	17,29 %	–
	Klasse X GBP, ausschüttend (Q)	30.05.2019	GBP	8,93 %	7,19 %	22,33 %	–
	Klasse X GBP ausschüttend (Q) (abgesichert)	11.09.2021	GBP	4,56 %	2,73 %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	02.04.2014	USD	-2,16 %	-4,16 %	12,65 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	15.02.2018	BRL	14,81 %	12,77 %	35,48 %	–
	Klasse Premier CAD, ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	16.06.2017	CAD	2,02 %	-0,30 %	16,35 %	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	05.11.2012	EUR	3,74 %	2,03 %	18,06 %	106,48 %
	Klasse Premier GBP, thesaurierend	30.06.2016	GBP	9,18 %	7,41 %	23,40 %	–
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	25.06.2009	GBP	1,23 %	-0,93 %	14,98 %	82,80 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (Q)	26.04.2018	GBP	9,20 %	7,34 %	23,32 %	–
	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	16.06.2021	USD	-8,42 %	-7,48 %	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus		30.04.2021	USD	-8,42 %	-7,48 %	–	–
Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)		30.04.2021	USD	-8,41 %	-7,49 %	–	–
Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		08.12.2021	AUD	-10,71 %	-9,46 %	–	–
Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		10.01.2021	CNH	-9,32 %	-7,71 %	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung	
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23	
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse A EUR, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	08.11.2021	EUR	-11,62 %	-10,40 %	–	–	
	Klasse A GBP, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	23.11.2021	GBP	-10,50 %	-9,34 %	–	–	
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus	07.01.2021	HKD	-8,01 %	-7,40 %	–	–	
	Klasse A SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16.06.2021	SGD	-9,30 %	-8,07 %	–	–	
	Klasse X USD, ausschüttend (M) Plus (e)	30.04.2021	USD	-7,74 %	-6,82 %	–	–	
	Klasse X EUR, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	30.04.2021	EUR	-10,97 %	-9,78 %	–	–	
	Klasse X GBP, ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	01.12.2022	GBP	-9,71 %	–	–	–	
	Premier Klasse USD, ausschüttend (M) Plus	06.09.2021	USD	-7,40 %	-6,46 %	–	–	
	Klasse Premier EUR, ausschüttend (M) (abgesichert)	24.06.2021	EUR	-10,55 %	-9,33 %	–	–	
	Klasse S USD, thesaurierend	17.06.2021	USD	-7,08 %	-6,13 %	–	–	
	Klasse S USD, ausschüttend (M) Plus	07.06.2021	USD	-7,08 %	-6,13 %	–	–	
	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	-4,14 %	-17,74 %	31,87 %	148,82 %
		Klasse A USD, ausschüttend (A)	11.08.2002	USD	-4,15 %	-17,74 %	31,87 %	148,80 %
		Klasse A AUD, thesaurierend (abgesichert)	06.03.2013	AUD	-7,11 %	-20,02 %	20,00 %	–
		Klasse A CNH, thesaurierend (abgesichert)	12.05.2016	CNH	-5,40 %	-18,14 %	34,94 %	–
Klasse A EUR, thesaurierend		07.12.2007	EUR	1,63 %	-12,49 %	38,03 %	206,53 %	
Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)		20.02.2013	EUR	-7,66 %	-20,48 %	23,66 %	109,49 %	
Klasse A EUR, ausschüttend (A) (abgesichert)		16.11.2016	EUR	-7,73 %	-20,53 %	23,05 %	–	
Klasse A GBP thesaurierend (abgesichert)		20.12.2013	GBP	-6,64 %	-19,76 %	23,53 %	–	
Klasse A GBP, ausschüttend (A)		26.04.2011	GBP	6,91 %	-7,90 %	44,43 %	216,08 %	
Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)		31.01.2013	SEK	-7,99 %	-20,86 %	19,63 %	100,75 %	
Klasse A SGD, thesaurierend		16.02.2011	SGD	-4,65 %	-18,24 %	30,94 %	169,21 %	
Klasse A SGD, thesaurierend (abgesichert)		09.10.2012	SGD	-5,20 %	-18,46 %	28,15 %	135,09 %	
Klasse B USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-4,62 %	-18,15 %	29,91 %	136,68 %	
Klasse B USD, ausschüttend (A)		24.02.2004	USD	-4,63 %	-18,16 %	29,85 %	136,47 %	
Klasse C USD, thesaurierend		15.11.2007	USD	-4,63 %	-18,15 %	29,91 %	136,67 %	
Klasse C USD, ausschüttend (A)		24.02.2004	USD	-4,62 %	-18,15 %	29,91 %	136,70 %	
Klasse E USD, thesaurierend		01.04.2011	USD	-4,86 %	-18,36 %	28,93 %	130,83 %	
Klasse E USD, ausschüttend (A)		01.04.2011	USD	-4,86 %	-18,35 %	28,94 %	130,83 %	
Klasse E EUR thesaurierend		26.11.2010	EUR	0,89 %	-13,19 %	34,91 %	185,05 %	
Klasse E EUR, thesaurierend (abgesichert)		23.09.2013	EUR	-8,31 %	-21,05 %	20,94 %	–	
Klasse F USD, thesaurierend		01.04.2011	USD	-3,57 %	-17,25 %	34,27 %	164,20 %	
Klasse F USD ausschüttend (A)		01.04.2011	USD	-3,57 %	-17,24 %	34,27 %	164,42 %	
Klasse R USD, thesaurierend		02.01.2021	USD	-3,06 %	-16,80 %	–	–	
Klasse R EUR, thesaurierend		12.09.2013	EUR	2,12 %	-12,08 %	40,59 %	–	
Klasse X USD thesaurierend		25.02.2013	USD	-3,42 %	-17,12 %	34,88 %	168,19 %	
Klasse X USD, ausschüttend (A)		28.11.2016	USD	-3,42 %	-17,12 %	34,88 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend		10.11.2017	EUR	2,35 %	-11,88 %	41,40 %	–	
Klasse X EUR, thesaurierend (abgesichert)		21.10.2013	EUR	-6,99 %	-19,90 %	26,42 %	–	
Klasse X GBP, thesaurierend		18.01.2013	GBP	7,73 %	-7,19 %	47,69 %	237,43 %	
Klasse X GBP, ausschüttend (A)		23.04.2013	GBP	7,75 %	-7,18 %	47,73 %	–	
Klasse Premier USD, thesaurierend		27.04.2010	USD	-3,09 %	-16,83 %	36,30 %	177,73 %	
Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)		15.02.2018	BRL	3,37 %	-10,72 %	41,23 %	–	
Klasse Premier EUR, thesaurierend		06.07.2010	EUR	2,71 %	-11,56 %	42,67 %	242,89 %	
Klasse Premier EUR, thesaurierend (abgesichert)	31.08.2015	EUR	-6,61 %	-19,56 %	27,86 %	–		
Klasse Premier GBP, thesaurierend	15.02.2013	GBP	8,09 %	-6,87 %	49,10 %	248,43 %		
Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	08.03.2018	PLN	-1,38 %	-15,37 %	34,18 %	–		
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	0,26 %	-15,43 %	14,85 %	98,21 %	
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	03.01.2004	USD	0,22 %	-15,45 %	14,80 %	97,96 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend	10.01.2008	EUR	6,28 %	-10,01 %	20,23 %	143,36 %	
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	06.05.2013	EUR	-3,44 %	-18,30 %	7,73 %	–	
	Klasse A EUR, ausschüttend (A)	02.09.2011	EUR	6,17 %	-10,14 %	20,05 %	148,16 %	
	Klasse A GBP, ausschüttend (A)	11.05.2009	GBP	11,75 %	-5,36 %	25,70 %	149,44 %	
	Klasse A SEK thesaurierend (abgesichert)	31.01.2013	SEK	-3,57 %	-18,55 %	5,20 %	62,37 %	
	Klasse C USD, thesaurierend	15.11.2007	USD	-0,24 %	-15,85 %	13,14 %	88,50 %	
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	03.01.2004	USD	-0,28 %	-15,87 %	13,09 %	88,31 %	
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-0,53 %	-16,08 %	12,24 %	83,66 %	
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	06.03.2020	USD	-0,58 %	-16,13 %	–	–	
	Klasse E EUR thesaurierend	14.01.2019	EUR	5,45 %	-10,77 %	17,60 %	–	
	Klasse F USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	0,83 %	-14,94 %	16,89 %	110,25 %	
	Klasse F USD ausschüttend (A)	02.04.2010	USD	0,82 %	-14,94 %	16,88 %	110,22 %	

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung 10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Royce US Smaller Companies Fund – (Fortsetzung)	Klasse R USD, thesaurierend	05.09.2014	USD	0,72 %	-15,03 %	16,54 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	02.08.2013	USD	0,97 %	-14,82 %	17,36 %	113,33 %
	Klasse X USD, ausschüttend (A)	15.04.2021	USD	1,16 %	-14,68 %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	24.11.2009	USD	1,33 %	-14,51 %	18,65 %	120,95 %
	Klasse Premier USD, ausschüttend (A)	18.02.2011	USD	1,33 %	-14,51 %	18,66 %	120,97 %
	Klasse Premier GBP, ausschüttend (A)	20.05.2011	GBP	13,02 %	-4,27 %	30,05 %	178,29 %
	Klasse LM EUR, thesaurierend	04.05.2016	EUR	8,22 %	-8,40 %	27,03 %	–
	Klasse A (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	0,83 %	-14,94 %	16,89 %	110,19 %
	Klasse L (G) USD, thesaurierend	20.04.2007	USD	0,32 %	-15,37 %	15,14 %	99,94 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	12.01.2021	USD	-7,50 %	-24,49 %	–	–
	Klasse X USD thesaurierend	12.01.2021	USD	-6,81 %	-23,93 %	–	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	12.01.2021	USD	-6,48 %	-23,66 %	–	–
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund	Klasse A USD, thesaurierend	05.09.2007	USD	-8,34 %	-8,83 %	-4,27 %	27,36 %
	Klasse A USD, ausschüttend (A)	25.02.2004	USD	-8,34 %	-8,82 %	-4,26 %	26,91 %
	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus	30.09.2014	USD	-8,34 %	-8,82 %	-4,27 %	–
	Klasse A AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21.07.2016	AUD	-10,40 %	-10,46 %	-8,59 %	–
	Klasse A CNH ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	16.04.2018	CNH	-9,31 %	-9,06 %	-1,16 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	31.10.2007	EUR	-2,89 %	-3,18 %	0,17 %	56,72 %
	Klasse A HKD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus	30.09.2014	HKD	-7,94 %	-8,74 %	-4,14 %	–
	Klasse B USD, ausschüttend (A)	24.06.2016	SGD	-9,01 %	-9,40 %	-5,67 %	–
	Klasse C USD, thesaurierend	25.02.2004	USD	-8,79 %	-9,27 %	-5,69 %	20,69 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	15.11.2007	USD	-8,80 %	-9,28 %	-5,69 %	21,07 %
	Klasse C USD, ausschüttend (A)	25.02.2004	USD	-8,80 %	-9,28 %	-5,69 %	20,67 %
	Klasse E USD, thesaurierend	21.01.2010	USD	-9,23 %	-9,70 %	-6,75 %	17,03 %
	Klasse E USD, ausschüttend (A)	07.05.2017	USD	-9,23 %	-9,70 %	-6,76 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	01.04.2011	USD	-8,00 %	-8,47 %	-2,90 %	33,94 %
	Klasse Premier PLN, thesaurierend (abgesichert)	10.08.2015	PLN	-4,73 %	-5,28 %	-0,01 %	–
	Klasse GA USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-8,48 %	-8,94 %	-4,40 %	27,82 %
	Klasse GA EUR, thesaurierend	27.08.2010	EUR	-2,97 %	-3,15 %	0,20 %	57,88 %
	Klasse GA EUR, ausschüttend (A)	27.08.2010	EUR	-2,92 %	-2,99 %	0,34 %	58,24 %
	Klasse GE USD, thesaurierend	27.08.2010	USD	-9,15 %	-9,61 %	-6,52 %	18,60 %
	FTGF Martin Currie Asia Long- Term Unconstrained Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	30.03.2016	USD	-13,52 %	-15,49 %	-12,01 %
Klasse M GBP, ausschüttend (A)		03.11.2016	GBP	-2,80 %	-4,62 %	-1,92 %	–
Klasse F USD, thesaurierend		30.03.2016	USD	-13,02 %	-14,99 %	-10,33 %	–
Klasse M USD ausschüttend (A)		03.11.2016	USD	-12,82 %	-14,83 %	-9,99 %	–
Klasse M EUR, ausschüttend (A)		03.11.2016	EUR	-7,59 %	-9,33 %	-4,96 %	–
Klasse Premier USD, thesaurierend		05.07.2018	USD	-12,45 %	-14,46 %	-8,87 %	–
Klasse Premier GBP, thesaurierend		05.09.2018	GBP	-2,35 %	-4,22 %	-0,29 %	–
FTGF Martin Currie Global Long- Term Unconstrained Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	28.06.2016	USD	-14,15 %	-33,67 %	-8,36 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	28.06.2016	EUR	-8,94 %	-29,41 %	-3,56 %	–
	Klasse A EUR, thesaurierend (abgesichert)	24.03.2021	EUR	-17,86 %	-36,28 %	–	–
	Klasse C USD, thesaurierend	09.09.2021	USD	-14,59 %	-34,00 %	–	–
	Klasse E USD, thesaurierend	14.08.2019	USD	-14,80 %	-34,16 %	-10,62 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	29.07.2021	USD	-13,64 %	-33,27 %	–	–
	Klasse X USD thesaurierend	04.01.2021	USD	-13,50 %	-33,17 %	–	–
	Klasse X USD, thesaurierend	28.06.2016	EUR	-8,29 %	-28,91 %	-1,58 %	–
	Klasse X GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	-3,53 %	-25,16 %	2,32 %	–
	Klasse X GBP thesaurierend (abgesichert)	28.06.2016	GBP	-16,24 %	-35,08 %	-11,37 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	28.06.2016	USD	-13,20 %	-32,93 %	-5,29 %	–
	Klasse Premier GBP, thesaurierend (abgesichert)	16.04.2019	GBP	-15,94 %	-34,85 %	-10,41 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	25.08.2020	USD	-12,90 %	-32,69 %	–	–
	Klasse S EUR, thesaurierend (abgesichert)	3. Mai 2021	EUR	-16,63 %	-35,34 %	–	–
	Klasse S GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	-2,91 %	-24,69 %	4,50 %	–
	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund	Klasse A USD, ausschüttend (M) Plus (e)	28.06.2016	USD	-6,76 %	-5,95 %	-6,71 %
Klasse A AUD, ausschüttend (M) Plus Klasse A EUR, ausschüttend (M) Plus (e)		28.06.2016	AUD	0,62 %	0,49 %	-3,85 %	–
Klasse A SGD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus		28.06.2016	EUR	-1,19 %	–	-2,26 %	–
Klasse D AUD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		09.12.2018	SGD	-7,35 %	-6,67 %	-7,43 %	–
Klasse D CNH, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		29.04.2020	AUD	-8,62 %	-7,56 %	–	–
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus		29.04.2020	CNH	-7,30 %	-5,79 %	–	–
Klasse D HKD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus		29.04.2020	HKD	-5,98 %	-5,51 %	–	–
Klasse D SGD, ausschüttend (M) (abgesichert) Plus		29.04.2020	SGD	-7,11 %	-6,20 %	–	–
Klasse D USD, ausschüttend (M) Plus (abgesichert) Plus		29.04.2020	USD	-6,40 %	-5,58 %	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungsdatum	Klasse CCY	Geschäftsjahr YTD 01/03/22-28/02/22	Kalenderjahr 01/01/22-31/12/22	3 Jahre kumulativ 01/01/20-31/12/22	Wertentwicklung
							10 Jahre 01/03/13-28/02/23
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse D USD, thesaurierend	29.04.2020	USD	-6,39 %	-5,58 %	–	–
	Klasse X AUD, thesaurierend	31.05.2017	AUD	1,34 %	1,20 %	-1,83 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	28.06.2016	USD	-6,07 %	-5,25 %	-4,58 %	–
	Klasse S GBP, thesaurierend	28.06.2016	GBP	5,46 %	6,79 %	6,65 %	–
	Klasse S GBP, ausschüttend (M) Plus (e)	28.06.2016	GBP	5,44 %	6,76 %	6,62 %	–
	Klasse LM AUD, thesaurierend	11.10.2017	AUD	2,52 %	2,36 %	1,67 %	–
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	Klasse A USD, thesaurierend	24.11.2017	USD	-18,16 %	-27,15 %	-13,90 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend	09.10.2018	USD	-18,77 %	-27,69 %	-15,65 %	–
	Klasse F USD, thesaurierend	13.11.2018	USD	-17,66 %	-26,71 %	-12,31 %	–
	Klasse X USD thesaurierend	13.12.2017	USD	-17,55 %	-26,60 %	-11,95 %	–
	Klasse Premier USD, thesaurierend	13.12.2017	USD	-17,25 %	-26,34 %	-11,00 %	–
	Klasse S USD, thesaurierend	29.10.2018	USD	-17,08 %	-26,18 %	-10,46 %	–
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	Klasse S EUR, thesaurierend	16.01.2018	EUR	-12,03 %	-21,44 %	-6,02 %	–
	Klasse A USD thesaurierend (abgesichert)	15.10.2021	USD	-6,82 %	-31,85 %	–	–
	Klasse A EUR, thesaurierend	11.09.2018	EUR	-10,00 %	-33,98 %	-3,62 %	–
	Klasse E USD, thesaurierend (abgesichert)	15.10.2021	USD	-7,51 %	-32,36 %	–	–
	Klasse X EUR, thesaurierend	11.09.2018	EUR	-9,33 %	-33,48 %	-1,43 %	–
	Klasse Premier BRL, thesaurierend (abgesichert)	06.01.2021	BRL	1,23 %	-25,78 %	–	–
	Klasse Premier EUR, thesaurierend	11.09.2018	EUR	-9,01 %	-33,25 %	-0,39 %	–
	Klasse S EUR, thesaurierend	05.07.2019	EUR	-8,65 %	-32,99 %	0,81 %	–
Klasse S GBP, thesaurierend	19.11.2021	GBP	-3,91 %	-29,46 %	–	–	

In den Daten zur Wertentwicklung der Fonds sind die Gebühren und Kosten für die Ausgabe und Rücknahme von Anteilen nicht berücksichtigt.

Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist kein Hinweis für die künftige Entwicklung.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlagenportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilinhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese bestehen aus den Gesamtankäufen und -verkäufen einer Investition (einschließlich der Fälligkeiten und ausschließlich der Rückkaufvereinbarungen, Diskontanleihen und Termingeldanlagen, die von einem Tag auf den anderen getätigt werden und die hauptsächlich dazu dienen, die Portfolios effizient zu verwalten), die 1,00 % des Gesamtwertes der Ankäufe und Verkäufe für das Geschäftsjahr übersteigen. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und 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

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
FHLDN, 0,000 %, fällig 16.09.2022	92.911	FHLDN, 0,000 %, fällig 16.09.2022	92.964
FHLDN, 0,000 %, fällig 15.12.2022	81.432	FHLDN, 0,000 %, fällig 15.12.2022	81.440
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 15.09.2022	71.618	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 29.03.2022	73.692
FHLDN, 0,000 %, fällig 16.12.2022	70.872	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 15.09.2022	71.643
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 29.03.2022	63.690	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 22.03.2022	71.558
FHLDN, 0,000 %, fällig 19.09.2022	60.009	FHLDN, 0,000 %, fällig 16.12.2022	70.880
United States Floating Rate Note, fällig 31.01.2023	55.071	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.03.2022	66.337
FHLDN, 0,000 %, fällig 11.05.2022	52.219	FHLDN, 0,000 %, fällig 19.09.2022	60.020
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 22.03.2022	51.557	United States Floating Rate Note, fällig 31.01.2023	55.007
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 15.03.2022	51.337	FHLDN, 0,000 %, fällig 11.05.2022	52.223
FHLDN, 0,000 %, fällig 04.08.2022	49.997	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.03.2022	50.250
Federal Home Loan Bank Discount, 18.03.2022	47.232	FHLDN, 0,000 %, fällig 04.08.2022	50.000
FHLDN, 0,000 %, fällig 20.09.2022	44.277	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.10.2022	50.000
FHLDN, 0,000 %, fällig 15.06.2022	44.220	Federal Home Loan Bank Discount, 18.03.2022	47.232
Federal Home Loan Bank Discount, 25.03.2022	42.723	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.03.2022	45.876
Federal Home Loan Bank Discount, 01.11.2022	41.999	FHLDN, 0,000 %, fällig 09.20.2022	44.280
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.12.2022	40.700	FHLDN, 0,000 %, fällig 15.06.2022	44.223
FHLDN, 0,000 %, fällig 19.10.2022	38.877	Federal Home Loan Bank Discount, 25.03.2022	42.723
FHLDN, 0,000 %, fällig 29.04.2022	37.364	FHLDN, 0,000 %, fällig 01.11.2022	42.000
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 28.02.2023	36.925	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 04.12.2022	40.702

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	93.701	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	97.430
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2027	8.358	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	7.565
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	6.201	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	6.195
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	5.624	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	5.742
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	5.134	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	5.053
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	4.952	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,500 %	5.039
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	4.194	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	4.315
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	4.049	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	4.176
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.925	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	4.006
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.786	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.903
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.720	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.712
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.660	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.668
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	3.304	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	3.229
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.099	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	3.210
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	3.007	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.053
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.989	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	3.026
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	2.925	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.882
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.915	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.873
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.885	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.835
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.829	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.661

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.079	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	55.871
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.848	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	46.834
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	39.904	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	41.835
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.654	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.863
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	32.946	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.048
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	32.320	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	32.843
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	31.421	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	32.837
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	29.597	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	31.948
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.406	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	31.464
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.340	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	30.230
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.105	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.511
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	26.360	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	28.302
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.879	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	27.895
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.096	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	26.911
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.037	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	25.441
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.544	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.932
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.043	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.753
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	22.821	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	24.733
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	22.816	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	23.847
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	21.282	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	22.792

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

FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) EUR	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	10.438	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.192
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	9.002	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	9.073
Staatsanleihe des Königreichs der Niederlande, 0,000 %, fällig 15.07.2023	5.916	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	4.286
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	5.582	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	3.971
Österreichische Staatsanleihe, 0,900 %, fällig 20.02.2032	3.352	Bundesobligation, Serie 177, 0,000 %, fällig am 14.04.2023	3.256
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.684	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 4,500 %, fällig 01.03.2024	3.187
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032	1.471	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2030	3.075
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, 2,500 %, fällig 01.12.2032	1.430	Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 4,200 %, fällig 15.10.2050	2.107
Staatsanleihe der Republik Irland, 0,350 %, fällig 18.10.2032	1.415	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	1.914
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	1.322	Spain Government Bond, 0,450 %, fällig 31.10.2022	1.353
BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028	1.251	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	1.259
Bank of Montreal, 2,750 %, fällig am 15.06.2027	1.249	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 30.06.2025	1.227
HSBC Holdings Plc, 3,019 %, fällig am 15.06.2027	1.220	KBC Group NV, 0,022 %, fällig 24.11.2022	1.100
Banco Santander SA, 2,500 %, fällig 18.03.2025	1.092	Vonovia Finance BV, 0,000 %, fällig 22.12.2022	1.100
Spain Government Bond, 144A, 1,400 %, fällig 30.04.2028	1.002	Internationale Anleihe der Regierung von Katar, 4,817 %, fällig 14.03.2049	1.020
Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	887	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,500 %, fällig 15.02.2023	1.010
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2030	751	ABN AMRO Bank NV, 7,125 %, fällig 06.07.2022	850
Suzano Austria GmbH, 3,125 %, fällig 15.01.2032	693	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2025	787
Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig am 24.01.2028	686	Norway Government Bond, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	733
Credit Agricole SA, 1,875 %, fällig 22.04.2027	663	Staatsanleihe der französischen Republik OAT, 1,000 %, fällig 25.05.2027	676
French Republic Government Bond OAT, 3,250 %, fällig 25.05.2045	653	Volkswagen International Finance NV, 1,250 %, fällig 23.09.2032	644
Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig am 14.06.2027	635		

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund^A

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	536	Ford Motor Credit Co LLC, 2,700 %, fällig 10.08.2026	748
Thermostat Purchaser III Inc, 0,000 %, fällig 31.08.2028	265	DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026	747
Legacy LifePoint Health LLC, 6,750 %, fällig 15.04.2025	264	Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	625
Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig am 28.05.2027	220	Penn Virginia Holdings LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.08.2026	594
Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, fällig 15.06.2027	210	Five Point Operating Co LP / Five Point Capital Corp, 144A, 7,875 %, fällig am 15.11.2025	482
Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 11.04.2027	200	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	478
Credit Suisse Group AG, 9,750 %, fortwährend	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,750 %, fällig 09.05.2027	470
InterGen NV, 7,000 %, fällig 30.06.2023	197	Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	466
Ballyrock CLO 19 Ltd FRN, 0,000 %, fällig 20.04.2035	196	Adtalem Global Education Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.03.2028	452
Canpack SA / Canpack US LLC, 3,125 %, fällig 01.11.2025	187	Occidental Petroleum Corp, 3,400 %, fällig am 15.04.2026	448
Ford Motor Credit Co LLC, 4,125 %, fällig am 17.08.2027	178	Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,250 %, fällig am 01.07.2025	442
Holly Energy Partners LP, 6,375 %, fällig 15.04.2027	170	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	440
American Airlines Inc, 5,750 %, fällig 20.04.2029	169	United Airlines Inc, 144A, 4,375 %, fällig 15.04.2026	429
CommScope Inc, 4,750 %, fällig 01.09.2029	168	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	422
AMC Entertainment Holdings Inc, 7,500 %, fällig 15.02.2029	165	American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig am 20.04.2026	422
Vertiv Group Corp, 4,125 %, fällig 15.11.2028	162	Oasis Petroleum Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.06.2026	405
GEO Group Inc/The, 9,500 %, fällig 31.12.2028	160	Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig am 15.08.2026	400
Bausch Health Co Inc, 6,250 %, fällig 15.02.2029	152	Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	397
Melco Resorts Finance Ltd, 4,875 %, fällig 06.06.2025	151	Highlands Holdings Bond Issuer Ltd / Highlands Holdings Bond Co-Issuer Inc, 144A, 7,625 %, fällig am 15.10.2025	385
Carnival Holdings Bermuda Ltd, 10,375 %, fällig 01.05.2028	138	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027	376
Gen Digital Inc, 6,750 %, fällig 30.09.2027	130		
Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	126		
XPO Inc, 6,250 %, fällig 01.05.2025	124		
Nabors Industries Ltd, 7,250 %, fällig 15.01.2026	122		
Bombardier Inc, 7,875 %, fällig 15.04.2027	122		
Royal Caribbean Cruises Ltd, 11,625 %, fällig 15.08.2027	120		
Blackstone Mortgage Trust Inc, 5,500 %, fällig am 15.03.2027	110		
Service Properties Trust, 4,650 %, fällig am 15.03.2024	96		
GEO Group Inc/The, 10,500 %, fällig 30.06.2028	87		
Michael Cos Inc/The, 7,875 %, fällig 01.05.2026	69		
Earthstone Energy Holdings LLC, 8,000 %, fällig 15.04.2027	60		

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	6.249	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse Euro (thesaurierend)	9.302
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 30.04.2024	6.033	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	6.388
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034	5.292	China Government Bond, 4,290 %, fällig 22.05.2029	6.202
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028	4.856	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034	5.292
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2031	3.614	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	4.995
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032	3.523	Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	4.856
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	3.450	United States Treasury Note/Bond, 2,875 % fällig 15.05.2032	3.325
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	3.344	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2025	3.091
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029	1.584	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2023	2.682
ING Groep NV, 5,000 %, fällig 30.08.2026	1.298	MEG Energy Corp, 7,125 %, fällig 01.02.2027	2.130
Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	1.288	Itau Unibanco Holding SA, Cayman Island, 6,125 %, fortwährend	2.094
Credit Suisse Group AG, 6,373 %, fällig 15.07.2026	1.280	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C01, Klasse 1M2, 3,377 %, fällig 25.07.2029	2.091
Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031	1.273	Mexican Bonos, Serie M 20, 7,500 %, fällig 03.06.2027	2.056
Intesa Sanpaolo SpA, 6,375 %, fortwährend	1.263	FirstEnergy Corp, Serie C, 7,375 %, fällig 15.11.2031	1.928
H&E Equipment Services Inc, 144A, 3,875 %, fällig am 15.12.2028	1.225		
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	1.206		
Banco Mercantil del Norte SA, Grand Cayman, 7,500 %, fortwährend	1.206		
B3 SA – Brasil Bolsa Balcão, 144A, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	1.194		
Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026	1.119		

^A In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042	1.084	Ultrapar International SA, 144A, 5,250 %, fällig 06.10.2026	1.745
BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig 31.03.2032	985	China Government Bond, 3,950 %, fällig 29.06.2043	1.699
		HSI Asset Securitization Corp Trust 2007-OPT1, Series 2007 OPT1, Class 1A, 0,327 %, fällig 25.12.2036	1.690
		Petrobras Global Finance BV, 6,250 %, fällig am 17.03.2024	1.661
		Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – LM Klasse US\$ thesaurierend	1.615
		Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	1.584
		OCP SA, 4,500 %, fällig 22.10.2025	1.550
		Scientific Games International Inc, 2,959 %, fällig 14.08.2024	1.407

FTGF Western Asset US High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	111.008	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	110.261
Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	1.977	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	2.511
Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	1.654	Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	2.072
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.613	CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	1.912
Foot Locker Inc, 144A, 4,000 %, fällig am 01.10.2029	1.475	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	1.858
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, fortwährend	1.465	Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	1.774
Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	1.437	CommScope Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.03.2027	1.739
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.436	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	1.700
Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, fällig 15.06.2027	1.398	NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026	1.598
Chord Energy Corp, 144A, 6,375 %, fällig am 01.06.2026	1.347	Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	1.517
Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.275	Global Aircraft Leasing Co Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 15.09.2024	1.507
Southwestern Energy Co, 4,750 %, fällig am 01.02.2032	1.256	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	1.504
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 5,125 %, fällig 09.05.2029	1.163	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	1.454
United Rentals North America Inc, 5,250 %, fällig am 15.01.2030	1.138	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	1.415
Par Pharmaceutical Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.04.2027	1.117	Bath & Body Works Inc, 144A, 6,625 %, fällig am 01.10.2030	1.411
Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig am 01.11.2033	1.116	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	1.405
GEO Group Inc/The, 9,500 %, fällig 31.12.2028	1.113	Virgin Media Secured Finance Plc, 144A, 5,500 %, fällig 15.05.2029	1.386
Berry Petroleum Co LLC, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2026	1.097	MEG Energy Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2027	1.380
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd / HawaiianMiles Loyalty Ltd, 144A, 5,750 %, fällig am 20.01.2026	1.081	Ardagh Metal Packaging Finance USA, 6,000 %, fällig 15.06.2027	1.367
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig am 15.04.2030	1.080	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig am 01.10.2029	1.343

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in 000's) USD
International Finance Corp, 8,250 %, fällig 30.01.2023	434	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	3.781
Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 8,375 %, fällig 24.03.2029	300	Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	506
Asian Development Bank, 2,715 %, fällig 16.01.2023	299	Internationale Anleihe der Regierung von Jamaika, 6,750 %, fällig 28.04.2028	474
Ras Laffan Liquefied Natural Gas C, 5,838 %, fällig 30.09.2027	226	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria Colombia SA, 4,875 %, fällig am 21.04.2025	473
International Finance Corp, 6,280 %, 27.05.2024	219	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	464
Asian Development Bank, 4,500 %, fällig 07.12.2023	215	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT, 6,530 %, fällig am 15.11.2028	457
Internationale Anleihe der Regierung von Uruguay, 4,975 %, fällig 25.04.2055	211	Internationale Anleihe der Regierung von Oman, 4,125 %, fällig am 17.01.2023	457
Abu Dhabi National Energy Co, 4,375 %, fällig 23.04.2025	203	MEGlobal Canada ULC, 5,875 %, fällig am 18.05.2030	457
CDBL Funding 1, 4,250 %, fällig 02.12.2024	202	Oversea-Chinese Banking Corp Ltd, 4,250 %, fällig am 19.06.2024	453
Banco Santander Mexico SA, 5,375 %, fällig 17.04.2025	201	Turk Telekomunikasyon AS, 4,875 %, fällig 19.06.2024	450
Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 8,250 %, fällig 09.05.2028	200	United Overseas Bank Ltd, 3,750 %, fällig 15.04.2029	448
Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 8,750 %, fällig 14.04.2032	200	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 6,000 %, fällig am 15.04.2024	448
Consorcio Transmataro SA, 5,200 %, fällig 11.04.2038	200	Ultrapar International SA, 5,250 %, fällig am 06.10.2026	445
Misc Capital Two Labuan Ltd, 3,625 %, fällig am 06.04.2025	200	Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	443
Korea Water Resources Corp, 3,500 %, fällig 27.04.2025	199	Itau Unibanco Holding SA, Cayman Island, 6,125 %, fortwährend	433
Banco Nacional de Comercio Exterior, 4,375 %, fällig 14.10.2025	199	Internationale Anleihe der Regierung von Bahrain, 6,750 %, fällig 20.09.2029	430
Southern Copper Corp, 3,875 %, fällig 23.04.2025	199	Lukoil International Finance BV, 6,656 %, fällig 07.06.2022	430
Korea Gas Corp, 3,875 %, fällig 13.07.2027	199	Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30.09.2023	429
Internationale Anleihe der jordanischen Regierung, 7,750 %, fällig 15.01.2028	198	DBS Group Holdings Ltd, 3,300 %, Ewige Anleihe	426
SingTel Group Treasury Pte Ltd, 3,250 %, fällig am 30.06.2025	197	International Finance Corp, 8,250 %, fällig 30.01.2023	423
ICICI Bank Ltd/Dubai, 4,000 %, fällig 18.03.2026	197		
Antofagasta PLC, 5,625 %, fällig 13.05.2032	196		
Freeport Indonesia PT, 4,673 %, fällig 14.04.2027	196		
NTPC Ltd, 4,500 %, fällig 19.03.2028	196		
Singapore Airlines Ltd, 3,000 %, fällig 20.07.2026	193		
Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	192		
Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 3,650 %, fällig am 02.11.2029	192		
EXPORT-IMPORT BK INDIA, 3,375 %, fällig 05.08.2026	192		
Foxconn Far East Ltd, 3,000 %, fällig am 23.09.2026	190		
Banco del Estado de Chile, 2,704 %, fällig am 09.01.2025	190		
Banco de Credito del Peru SA, 2,700 %, fällig am 11.01.2025	190		
Indian Railway Finance Corp Ltd, 3,835 %, fällig am 13.12.2027	189		
Transportadora de Gas Internacional, 5,550 %, fällig 01.11.2028	189		
CBQ Finance Ltd, 2,000 %, fällig 15.09.2025	188		
CCBL Cayman 1 Corp Ltd, 1,990 %, fällig 21.07.2025	188		
America Movil SAB de CV, 3,625 %, fällig 22.04.2029	187		
ST Engineering RHQ Ltd, 1,500 %, fällig 29.04.2025	187		
Empresa Nacional del Petroleo, 3,750 %, fällig 05.08.2026	187		
CDBL Funding 2, 2,000 %, fällig 04.03.2026	186		
Inventive Global Investments Ltd, 1,650 %, fällig am 03.09.2025	186		
Chinalco Capital Holdings Ltd, 2,125 %, fällig 03.06.2026	185		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD
Kallpa Generacion SA, 4,125 %, fällig 16.08.2027	185
Kia Corp, 2,750 %, fällig 14.02.2027	184
Transelect SA, 3,875 %, fällig 12.01.2029	183
ICBCIL Finance Co Ltd, 1,750 %, fällig 02.08.2026	182
Braskem Netherlands Finance BV, 4,500 %, fällig 10.01.2028	182
QNB Finance Ltd, 1,375 %, fällig 26.01.2026	182
Korea South-East Power, 1,000 %, fällig 03.02.2026	181
Consorcio Transmantaro SA, 4,700 %, fällig 16.04.2034	181
TSMC Arizona Corp, 1,750 %, fällig 25.10.2026	181
MDGH GMTN RSC Ltd, 2,875 %, fällig 21.05.2030	180
Hyundai Assan Otomotiv Sanayi ve T, 1,625 %, fällig 12.07.2026	179
Hana Bank, 1,250 %, fällig 16.12.2026	178
Vale Overseas Ltd, 3,750 %, fällig 08.07.2030	177
Empresa Generadora de Electricidad, 5,625 %, fällig 08.11.2028	174
GNL Quintero SA, 4,634 %, fällig 31.07.2029	171
Internationale Anleihe der brasilianischen Regierung, 3,875 %, fällig 12.06.2030	170
Petronas Capital Ltd, 2,480 %, fällig 28.01.2032	170
Engie Energia Chile SA, 3,400 %, fällig 28.01.2030	169
AIRPORT AUTHORITY HK, 1,625 %, fällig 04.02.2031	168
GC Treasury Center Co Ltd, 2,980 %, fällig 18.03.2031	168
DP World Ltd/United Arab Emirates, 4,700 %, fällig 30.09.2049	166
Internationale Anleihe der mexikanischen Regierung, 2,659 %, fällig am 24.05.2031	164
Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 1,850 %, fällig 12.03.2031	164
Internationale Anleihe der chilenischen Regierung, 2,550 %, fällig 27.07.2033	163
Alpek SAB de CV, 3,250 %, fällig 25.02.2031	162
Pertamina Persero PT, 2,300 %, fällig 09.02.2031	161
Banco Nacional de Panama, 2,500 %, fällig am 11.08.2030	160
Staatsanleihe Costa Rica, 5,625 %, fällig 30.04.2043	157
Comision Federal de Electricidad, 3,348 %, fällig 09.02.2031	156
Qatar Energy, 3,125 %, fällig 12.07.2041	156
Cemex SAB de CV, 3,875 %, fällig 11.07.2031	154
Internationale Anleihe der Regierung von Paraguay, 2,739 %, fällig 29.01.2033	152
Fondo Mivivienda SA, 4,625 %, fällig 12.04.2027	149
Internationale Anleihe der südafrikanischen Regierung, 5,375 %, fällig 24.07.2044	146

Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	343	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	724
Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 8,750 %, fällig 14.04.2032	200	Prosperous Ray Ltd, 4,625 %, fällig 12.11.2023	535
Consorcio Transmantaro SA, 5,200 %, fällig 11.04.2038	200	Liquid Telecommunications Financing Plc, 5,500 %, fällig 04.09.2026	436
Internationale Anleihe der Regierung von Nigeria, 8,375 %, fällig 24.03.2029	200	Bharti Airtel Ltd, 4,375 %, fällig 10.06.2025	398
		Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC, 4,600 %, fällig 02.11.2047	396
		Huarong Finance 2019 Co Ltd, 2,125 %, fällig 30.09.2023	385
		Banco General SA, 5,250 %, fortwährend	381
		First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027	376
		NBK Tier 1 Ltd, 3,625 %, fortwährend	374
		OCP SA, 5,125 %, fällig 23.06.2051	373
		Sagicor Financial Co Ltd, 5,300 %, fällig 13.05.2028	364
		Volcan Cia Minera SAA, 4,375 %, fällig 11.02.2026	362
		Shinhan Bank Co Ltd, 3,875 %, fällig 24.03.2026	346
		B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 4,125 %, fällig am 20.09.2031	342
		Oleoducto Central SA, 4,000 %, fällig 14.07.2027	341
		Sociedad Quimica y Minera de Chile SA, 4,250 %, fällig 07.05.2029	340
		Sands China Ltd, 5,400 %, fällig am 08.08.2028	337
		ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026	331
		Vale Overseas Ltd, 6,875 %, fällig 10.11.2039	317
		Sasol Financing USA LLC, 4,375 %, fällig 18.09.2026	312
		Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig am 05.06.2115	307
		Itau Unibanco Holding SA. Cayman Island, 6,125 %, fortwährend	291
		Transportadora de Gas del Peru SA, 4,250 %, fällig am 30.04.2028	287
		Mizrahi Tefahot Bank Ltd, 144A, 3,077 %, fällig am 07.04.2031	265
		Fresnillo Plc, 4,250 %, fällig 02.10.2050	262

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	1.793	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund – LM Klasse Euro (thesaurierend)	3.283
United States Treasury Note/Bond, Nullkupon, fällig 29.12.2022	1.499	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	1.788
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	1.463	Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)	1.761
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	1.395	United States Treasury Note/Bond, Nullkupon, fällig 29.12.2022	1.500
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.06.2025	1.225	Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	1.484
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	1.162	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025	1.457
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 19.01.2028	1.140	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.06.2025	1.234
Credit Suisse Group AG, 144A, 7,250 %, fortwährend	799	Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	1.140
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029	799	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	963
Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	769	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	936
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	711	EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	914
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	679		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Service Properties Trust, 5,500 %, fällig am 15.12.2027	664	DIRECTV Financing LLC, 5,750 %, fällig 22.07.2027	862
Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig am 08.08.2029	646	Las Vegas Sands Corp, 3,900 %, fällig am 08.08.2029	847
NCL Finance Ltd, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2028	643	Petroleos Mexicanos, 6,625 %, fällig 15.06.2035	831
CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	624	Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	799
Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig am 15.08.2027	621	United Airlines Inc, 4,500 %, fällig 14.04.2028	732
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2025	572	Indonesia Treasury Bond, Serie FR61, 7,000 %, fällig 15.05.2022	687
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	571	Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig am 15.02.2029	649
Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032	569	Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	620
Yuzhou Group, 0,000 %, fällig 25.10.2023	550	United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	580
Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	548	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2025	572
CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	536	Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 6,750 %, fällig am 02.05.2025	568
NCL Corp Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 15.12.2024	506	Energy Transfer LP, Serie F, 6,750 %, Ewige Anleihe	565
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.08.2023	498	United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 28.02.2026	557
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 15.09.2025	493	CoreCivic Inc, 8,250 %, fällig 15.04.2026	553
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.09.2023	493	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend	551
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.12.2023	480	Yuzhou Group Holdings Co Ltd, 6,000 %, fällig 25.10.2023	550
Internationale Anleihe der ukrainischen Regierung, 144A, 7,750 %, fällig 01.09.2028	457		
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027	446		
American Airlines Inc/Advantage Loyalty IP Ltd, 5,750 %, fällig 20.04.2029	445		
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.04.2027	445		
Jordan Government International Bond, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	436		

Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	8.516	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.04.2023	12.196
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027	2.542	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	11.525
Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	2.033	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.01.2027	7.271
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,500 %, fällig 15.04.2030	1.921	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	3.908
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	1.842	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 3,875 %, fällig 15.04.2029	3.726
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.07.2031	1.736	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,500 %, fällig 15.04.2030	3.715
Bundesbol, 0,000 %, fällig 16.04.2027	1.432	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 0,250 %, fällig 25.07.2024	3.463
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,690 %, fällig 15.09.2023	1.380	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 3,100 %, fällig 15.09.2026	3.205
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,125 %, fällig 15.01.2030	1.252	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 22, 0,100 %, fällig 10.03.2027	2.752
United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028	1.176	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.05.2026	2.577
Staatsanleihe der französischen Regierung OAT, Serie OATe, 0,000 %, fällig 25.11.2030	1.026	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,375 %, fällig 15.07.2025	2.395
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,000 %, fällig 15.02.2031	932	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,100 %, fällig 15.04.2023	2.104
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.04.2023	829	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,625 %, fällig 15.01.2026	2.074
Poland Government Bond, 1,750 %, fällig 25.04.2032	726	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	2.030
French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 0,250 %, fällig 25.07.2024	615	French Republic Government Bond OAT, Serie OATe, 1,850 %, fällig am 25.07.2027	1.886
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 15.02.2044	550	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,500 %, fällig 15.01.2028	1.555
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.07.2027	479	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 0,250 %, fällig 31.07.2031	1.553
United Kingdom Inflation Linked Bond, 1,250 %, fällig 22.11.2027	454	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 23, 0,100 %, fällig 10.03.2028	1.501
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 15.05.2040	403	Bundesbol, 0,000 %, fällig 16.04.2027	1.431
Indonesia Treasury Bond, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039	343	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie CPI, 144A, 2,690 %, fällig 15.09.2023	1.328
		United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,375 %, fällig 31.10.2028	1.192
		Staatsanleihe der französischen Republik OAT, Serie OATe, 0,000 %, fällig 25.11.2030	963
		Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond, Serie I.L, 0,000 %, fällig 15.02.2031	921

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Korea Treasury Bond, Serie 3206, 3,375 %, fällig am 06.10.2032	17.969	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	151.338
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	14.857	Philippine Government International Bond, 3,900 %, fällig 26.11.2022	17.925
United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 15.12.2023	14.297	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	14.456
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 26.08.2022	14.069	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 26.08.2022	13.856
Staatsanleihe Malaysia, Serie 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	11.522	China Development Bank, Serie 2103, 3,300 %, fällig 03.03.2026	12.876
Internationale Anleihe der australischen Regierung, 0,250 %, fällig 21.11.2025	10.534	Internationale Anleihe der australischen Regierung, 0,250 %, fällig 21.11.2025	10.051
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 87, Nullkupon, fällig 10.04.2023	8.544	United States Treasury Note/Bond, 0,125 %, fällig 15.12.2023	9.225
Korea Treasury Bond, Serie 2409, 3,125 %, fällig am 09.10.2024	7.497	Egypt Government Bond, Serie INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	9.064
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 10.03.2023	7.350	BNP Paribas SA VAR, 5,250 %, fällig 12.07.2032	7.211
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 03.03.2023	7.281	Macquarie Group Ltd VAR, 4,500 %, fällig 18.08.2026	6.635
BNP Paribas SA VAR, 5,250 %, fällig 12.07.2032	7.162	China Development Bank, Serie 2008, 2,890 %, fällig am 22.06.2025	6.351
United Overseas Bank Ltd, 3,875 %, Ewige Anleihe	6.866	Malaysia Government Bond, Serie 0115, 3,955 %, fällig 15.09.2025	6.312
Macquarie Group Ltd VAR, 4,500 %, fällig 18.08.2026	6.572	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 18.11.2022	6.199
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 18.11.2022	6.241	NTPC Ltd, 7,250 %, fällig 03.05.2022	5.887
Indonesia Treasury Bond, Serie FR87, 6,500 %, fällig 15.02.2031	6.185	ABN AMRO Bank NV VAR, 5,500 %, fällig 05.10.2032	5.884
ABN AMRO Bank NV VAR, 5,500 %, fällig 05.10.2032	5.765	National Highways Authority of India, 7,300 %, fällig am 18.05.2022	5.800
Staatsanleihe Indien, 7,380 %, fällig 20.06.2027	4.818	Korea Treasury Bond, Serie 2912, 1,375 %, fällig am 12.10.2029	5.003
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	4.559	Malaysia Government Bond, Serie 0118, 3,882 %, fällig 14.03.2025	4.720
Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 09.12.2022	4.233	Monetary Authority of Singapore Bill, Serie 84, Nullkupon, fällig 09.12.2022	4.435
Westpac Banking Corp VAR, 4,650 %, fällig 07.09.2032	3.576	China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050	4.394
Mercatus Co-operative Ltd, Serie DMTN, 2,800 %, fällig 26.07.2024	3.280	CNI Capital Ltd, 3,970 %, fällig 01.11.2022	4.107
		Indonesia Treasury Bond, Serie FR52, 10,500 %, fällig 15.08.2030	3.817
		Westpac Banking Corp VAR, 4,650 %, fällig 07.09.2032	3.558

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	259.904	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	249.500
United States Treasury Note/Bond, 1,000 %, fällig 15.12.2024	35.523	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.11.2027	14.766
Niederländische Waterschapsbank NV, 4,500 %, fällig 18.06.2025	10.599	Bank of America Corp, 3,550 %, fällig am 05.03.2024	7.719
Svensk Exportkredit AB, 4,500 %, fällig 11.03.2026	7.291	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 15.05.2030	5.830
AstraZeneca Plc, 3,625 %, fällig am 03.03.2027	6.328	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.03.2026	5.125
Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig am 15.02.2027	5.676	Citigroup Inc, 3,300 %, fällig am 27.04.2025	4.413
Union Pacific Corp, 4,750 %, fällig 21.02.2026	5.316	Bank of Nova Scotia/The, 1,375 %, fällig 05.12.2023	3.837
American Express Co, 4,900 %, fällig 13.02.2026	5.216	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 1,000 %, fällig am 11.02.2023	3.811
ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	5.169	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2030	3.665
Sanofi, 1,250 %, fällig 06.04.2029	4.986	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 0,875 %, fällig 18.09.2023	2.334
GlaxoSmithKline Capital Plc, 1,375 %, fällig 12.09.2029	4.726	Nuveen LLC, 4,000 %, fällig 01.11.2028	2.217
Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033	4.605	Enel Finance International NV, 0,000 %, fällig 17.06.2024	2.098
UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	4.430	BP Capital Markets Plc, 3,506 %, fällig 17.03.2025	2.057
Coca-Cola Co/The, 0,125 %, fällig 15.03.2029	4.401	Prudential Financial Inc, 1,500 %, fällig am 10.03.2026	1.941
Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig am 24.01.2028	3.978	Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig am 30.11.2026	1.927
Siemens Financieringsmaatschappij NV, 3,375 %, fällig 24.08.2031	3.942	European Investment Bank, 0,750 %, fällig 14.07.2023	1.905
Texas Instruments Inc, 4,600 %, fällig 15.02.2028	3.843	Toyota Finance Australia Ltd, 1,584 %, fällig 21.04.2022	1.810
Roche Finance Europe BV, 3,204 %, fällig 27.08.2029	3.739	Lloyds Bank Corporate Markets Plc, 1,500 %, fällig 23.06.2023	1.801
CPIIB Capital Inc, 4,375 %, fällig 02.03.2026	3.620	Medtronic Global Holdings SCA, 0,250 %, fällig 02.07.2025	1.422
Danske Bank A/S, 4,625 %, fällig 13.04.2027	3.464	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	1.402

FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2025	18.824	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	18.053
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	9.010	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	17.142
United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 31.08.2025	8.257	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	15.851
Australia Government Bond, Serie 139, 3,250 %, fällig 21.04.2025	7.559	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	10.126
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 30.11.2023	4.789	Australia Government Bond, Serie 157, 3,250 %, fällig 21.04.2025	7.480
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 30.04.2025	4.447	Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	4.249
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029	4.249	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.126
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.147	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.074
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	4.068	United States Treasury Note/Bond, 0,250 %, fällig 30.06.2025	4.058
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.975	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.962
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	3.598	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.484
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.506	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.254
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	3.305	Japanese Government CPI Linked Bond, Serie 21, 0,100 %, fällig 10.03.2026	3.217
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	2.829	United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2025	3.188
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.720	Internationale Anleihe der indonesischen Regierung, 4,200 %, fällig 15.10.2050	2.793
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.643	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.714
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.506	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.668
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	2.235	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.566
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.957	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	2.329
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	1.889	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	2.140

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	22.704	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	22.863
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	937	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	976
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	656	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	611
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	650	UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	607
UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	630	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	590
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039	616	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029	572
Bundesobligation, Serie 182, 0,000 %, fällig 10.10.2025	559	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 3,700 %, fällig 02.04.2040	549
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029	558	NatWest Group Plc, 2,500 %, fällig 22.03.2023	486
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	479	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029	466
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027	421	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	456
Elo SACA, 4,875 %, fällig 08.12.2028	418	Elo SACA, 4,875 %, fällig 08.12.2028	419
Suez SACA, 1,875 %, fällig 24.05.2027	416	Intesa Sanpaolo SpA, 1,000 %, fällig am 04.07.2024	418
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029	390	Allianz SE, 4,750 %, Ewige Anleihe	414
Bank of America Corp, 2,676 %, fällig 19.06.2041	384	Annington Funding Plc, 1,650 %, fällig am 12.07.2024	410
Enel Finance International NV, 144A, 7,750 %, fällig 14.10.2052	382	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	401
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029	359	Schlumberger Holdings Corp, 4,000 %, fällig 21.12.2025	398
United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.04.2028	346	Marken & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026	373
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	326	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 2,875 %, fällig am 15.10.2026	372
SSE Plc, 4,000 %, fortwährend	292	Citigroup Inc, 8,125 %, fällig am 15.07.2039	365
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2025	276	Wells Fargo & Co, 1,000 %, fällig am 02.02.2027	355

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	338	Telefonica Europe BV, 4,375 %, fortwährend	900
		Schenck Process Holding GmbH/Darmstadt, 5,375 %, fällig am 15.06.2023	665
		Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig 07.04.2026	659
		Petrobras Global Finance BV, 6,625 %, fällig 16.01.2034	640
		Summer BC Holdco B SARL, 5,750 %, fällig am 31.10.2026	624

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Legg Mason Western Asset Euro High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

	ERLÖSE (in Tsd.) EUR
WICHTIGE VERKÄUFE	
Eircom Finance DAC, 2,625 %, fällig 15.02.2027	586
Tendam Brands SAU, 5,000 %, fällig am 15.09.2024	581
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 1,125 %, fällig am 15.10.2024	574
Galaxy Bidco Ltd, 6,500 %, fällig am 31.07.2026	571
Petroleos Mexicanos, 2,750 %, fällig 21.04.2027	550
ASR Media and Sponsorship Spa, 5,125 %, fällig am 01.08.2024	544
PCF GmbH, 4,750 %, fällig 15.04.2026	527
Telefonica Europe BV, Serie NC5, 3,000 %, Unbefristet	503
Victoria Plc, 3,625 %, fällig 24.08.2026	490
Allied Universal Holdco LLC.Allied Universal Finance Corp.Atlas Luxco 4 Sarl, 4,875 %, fällig 01.06.2028	485
Saga Plc, 5,500 %, fällig 15.07.2026	479
Trivium Packaging Finance BV, 3,750 %, fällig am 15.08.2026	466
Renk AG/Frankfurt am Main, 5,750 %, fällig am 15.07.2025	461
United Group BV, 4,000 %, fällig 15.11.2027	455
Energia Group NI FinanceCo Plc/Energia Group ROI Holdings DAC, 4,000 %, fällig am 15.09.2025	453
Verisure Holding AB, 3,875 %, fällig 15.07.2026	450
Cheplapharm Arzneimittel GmbH, 4,375 %, fällig 15.01.2028	437
Wheel Bidco Ltd, 6,750 %, fällig 15.07.2026	437
Schoeller Packaging BV, 6,375 %, fällig 01.11.2024	429
Altice France Holding SA, 8,000 %, fällig 15.05.2027	425
Telecom Italia SpA.Milano, 3,625 %, fällig 25.05.2026	412
RCS & RDS SA, 3,250 %, fällig 05.02.2028	412
Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig am 18.09.2027	410
Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig am 15.07.2031	407
Nidda BondCo GmbH, 5,000 %, fällig 30.09.2025	403
ZF Finance GmbH, 2,000 %, fällig 06.05.2027	393
Renault SA, 2,500 %, fällig 01.04.2028	388
Kapla Holding SAS, 3,375 %, fällig 15.12.2026	379
Marcolin SpA, 6,125 %, fällig 15.11.2026	374
International Game Technology Plc, 2,375 %, fällig am 15.04.2028	369
Pinewood Finance Co Ltd, 3,250 %, fällig 30.09.2025	350
Repsol International Finance BV, 4,500 %, fällig 25.03.2025	350
CT Investment GmbH, 5,500 %, fällig 15.04.2026	338
Brunello Bidco SpA, 3,750 %, fällig 15.02.2028	334
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	330
Ideal Standard International SA, 6,375 %, fällig am 30.07.2026	326
Marston's Issuer Plc, Serie B1, 3,049 %, fällig 16.07.2035	313
Goldstory SASU, 5,375 %, fällig am 01.03.2026	308
United Group BV, 5,250 %, fällig 01.02.2030	307

FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2.296.315	
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	433.569	
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027	242.054	
Russian Federal Bond – OFZ, 7,050 %, fällig 19.01.2028	174.142	
United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	151.757	
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029	121.932	
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029	89.178	
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 10.05.2034	82.074	
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	74.960	
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 03.02.2027	73.240	
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	68.219	
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	65.653	
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032	63.143	
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	58.986	
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 16.03.2039	54.137	
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029	47.391	
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	46.268	
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029	42.351	
United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 31.08.2029	42.077	
United States Treasury Note/Bond, 2,625 %, fällig 31.07.2029	41.572	
WICHTIGE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		2.279.946
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		349.149
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027		237.301
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042		214.814
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028		174.142
Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM		149.026
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029		121.932
United States Treasury Note/Bond, 2,775 %, fällig 31.05.2029		89.273
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6225, 7,250 %, fällig 10.05.2034		82.074
China Government Bond, Serie INBK, 3,390 %, fällig 16.03.2050		75.611
Indonesia Treasury Bond, Serie FR82, 7,000 %, fällig 15.09.2030		74.631
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6207, 8,150 %, fällig 03.02.2027		73.240
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		62.172
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051		61.941
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Serie 6230, 7,500 %, fällig 19.01.2028		55.907
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6230, 7,700 %, fällig 16.03.2039		54.137
United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042		53.689
Staatsanleihe Australien, Series 150, 3,000 %, fällig 21.03.2047		52.666
Occidental Petroleum Corp, Nullkupon, fällig 10.10.2036		48.876
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029		47.265

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024	11.350	
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028	6.122	
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2024	5.782	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	4.876	
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	2.517	
Fannie Mae Pool, 4,500 %, fällig 01.01.2053	2.461	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.448	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.415	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.073	
Warnermedia Holdings Inc, 144A, 3,755 %, fällig 15.03.2027	2.013	
Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	1.973	
WICHTIGE VERKÄUFE		
United States Treasury Note/Bond, 0,500 %, fällig 30.11.2023		21.046
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 29.02.2024		11.225
Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028		6.122
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 31.03.2024		5.713
Targa Resources Corp, Serie A		5.345
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %		4.876
Southwestern Energy Co, 7,750 %, fällig 01.10.2027		2.997
Legg Mason Global Funds Plc – Legg Mason Western Asset Emerging Markets Corporate Bond Fund – LM Klasse US\$ ausschüttend (M)		2.706
Indonesia Treasury Bond, Serie FR56, 8,375 %, fällig 15.09.2026		2.678
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %		2.449

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		
Southwestern Energy Co, 7,750 %, fällig 01.10.2027	1.719	
ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025	1.642	
Southwestern Energy Co, 8,375 %, fällig 15.09.2028	1.561	
Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, fällig 05.04.2022	1.560	
Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	1.553	
Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig am 15.06.2029	1.489	
Gen Digital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.09.2030	1.439	
United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 30.11.2024	1.401	
Darling Ingredients Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2030	1.374	
		WICHTIGE VERKÄUFE
		Fannie Mae Pool, 4,500 %, fällig 01.01.2053
		Carnival Corp, 144A, 9,875 %, fällig 01.08.2027
		United States Treasury Note/Bond, 2,500 %, fällig 31.05.2024
		Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset European Loan Fund – Klasse LM Euro thesaurierend
		Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6212, 7,050 %, fällig 19.01.2028
		Delta Air Lines Inc, 144A, 7,000 %, fällig am 01.05.2025
		Indonesia Government International Bond, 5,250 %, fällig 17.01.2042
		Carnival Plc, 7,875 %, fällig 01.06.2027
		Royal Caribbean Cruises Ltd, 0,000 %, fällig 05.04.2022
		T-Mobile USA Inc, 4,750 %, fällig 01.02.2028

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	402.217	
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048	16.893	
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B6, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048	9.236	
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B5, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048	5.299	
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 6,867 %, fällig 27.02.2025	3.455	
PMT Credit Risk Transfer Trust, 144A, 8,217 %, fällig 29.04.2024	3.374	
Government National Mortgage Association, Series 2022 202, Class Z, 3,000 %, fällig 16.10.2063	2.964	
Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Serie 2022 JERI, Klasse G, 144A, 12,020 %, fällig 15.01.2039	2.912	
Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, fällig 15.01.2026	2.576	
Government National Mortgage Association, Series 2023 16, Class Z, 3,500 %, fällig 16.07.2063	1.896	
Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class B, 144A, 6,461 %, fällig 14.09.2022	1.343	
CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse AX1, 144A, 0,091 %, fällig 25.02.2048	1.319	
J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 8,608 %, fällig 15.10.2032	511	
Banc of America Funding 2015-R4 Trust, Serie 2015 R4, Klasse 4A3, 144A, 7,589 %, fällig 27.01.2030	323	
Freddie Mac STACR Remic Trust 2020-DNA2, Series 2020 DNA2, Class B2, 144A, 9,417 %, fällig 25.02.2050	88	
Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Serie 2005 9XS, Klasse M2, 5,592 %, fällig 25.06.2035	71	
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Serie 2006 1, Klasse M1, 5,172 %, fällig 25.04.2036	66	
BCAP LLC 2014-RR2, Serie 2014 RR2, Klasse 10A2, 144A, 3,540 %, fällig 26.07.2046	30	
DSL A Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Serie 2007 AR1, Klasse 2A1B, 4,771 %, fällig 19.04.2047	22	
IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 5,277 %, fällig 25.04.2035	19	
		WICHTIGE VERKÄUFE
		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)
		421.262
		CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, Klasse B7, 144A, 5,117 %, fällig 25.02.2048
		32.798
		CSMC Trust 2018-J1 Trust, Serie 2018 J1, 144A, 3,591 %, fällig 25.02.2048
		12.035
		CSMC Trust 2017-CHOP, Serie 2017 CHOP, Klasse F, 144A, 4,541 %, fällig 15.07.2032
		10.923
		BHMS 2018-MZB, Serie 2018 MZB, Klasse MZB, 144A, 11,224 %, fällig 15.07.2025
		9.588
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2017 C05, Klasse 1M2C, 2,387 %, fällig 25.01.2030
		8.657
		Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Serie 2019 1A, Klasse A2II, 144A, 4,723 %, fällig am 05.06.2049
		7.868
		Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Serie 2020 1A, Klasse D, 144A, 3,340 %, fällig am 20.08.2026
		7.841
		Radnor Re 2018-1 Ltd, Serie 2018 1, Klasse M2, 144A, 2,887 %, fällig 25.03.2028
		7.659
		KeyCorp Student Loan Trust 2005-A, Serie 2005 A, Klasse 2C, 1,520 %, fällig 27.12.2038
		7.569
		J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 8,608 %, fällig 15.10.2032
		7.255
		Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Serie 2019 FAME, Klasse D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036
		6.788
		ZH Trust 2021-1, Serie 2021 1, Klasse B, 144A, 3,262 %, fällig 18.02.2027
		6.540
		JP MORGAN MORTGAGE TRUST 2018-5, Serie 2018 5, Klasse B3, 144A, 3,750 %, fällig 25.10.2048
		6.536
		Bellemeade Re 2018-3 Ltd, Series 2018 3A, Class B1, 144A, 4,087 %, fällig 25.10.2028
		6.509
		Banc of America Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Serie 2017 BNK3, Klasse E, 144A, 4,495 %, fällig 15.02.2050
		6.467
		BBCMS Trust 2018-BXH, Serie 2018 BXH, Klasse C, 144A, 1,691 %, fällig 15.10.2037
		6.453
		G5 Mortgage Securities Corp Trust 2018-3PCK, Serie 2018 3PCK, Klasse B, 144A, 2,691 %, fällig 15.09.2031
		6.240
		Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2018 C05, Class 1B1, 4,437 %, fällig 25.01.2031
		6.151
		Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Serie 2020 R01, Klasse 1B1, 144A, 3,437 %, fällig 25.01.2040
		5.955

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

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	361.343	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	91.396	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	76.311	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	66.124	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	51.114	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	43.317	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	32.987	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	32.691	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	32.549	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	30.455	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	29.569	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	28.299	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	28.130	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	27.114	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	25.898	
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 22.11.2022	25.581	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	24.230	
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	24.200	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	23.524	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon	23.089	
		WICHTIGE VERKÄUFE
		Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)
		378.839
		United States Cash Management Bill, Nullkupon, fällig 03.05.2022
		104.644
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		91.396
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		74.020
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %
		72.634
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %
		69.546
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		64.102
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		51.192
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		33.271
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		32.555
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		29.654
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		29.513
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		27.892
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		27.497
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		27.157
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		26.028
		United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig am 22.11.2022
		25.597
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		24.224
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		23.966
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, Nullkupon
		23.521

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) GBP		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) GBP	
DNB Bank ASA, 2,625 %, fällig 10.06.2026		539	United Kingdom Gilt, 2,750 %, fällig 07.09.2024		1.914
Bank of America Corp, 4,948 %, fällig 22.07.2028		536	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau, 6,000 %, fällig 07.12.2028		738
Annington Funding Plc, 4,750 %, fällig 09.08.2033		520	Barclays Plc, 2,375 %, fällig 06.10.2023		608
New York Life Global Funding, 4,350 %, fällig 16.09.2025		490	Annington Funding Plc, 2,646 %, fällig 12.07.2025		585
DNB Bank ASA, 4,000 %, fällig 17.08.2027		480	CPUK Finance Ltd, 3,588 %, fällig 28.08.2025		546
Bank of America Corp, 3,584 %, fällig 27.04.2031		460	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029		542
Toronto-Dominion Bank/The, 2,875 %, fällig 05.04.2027		439	European Investment Bank, 3,750 %, fällig 07.12.2027		525
Morgan Stanley, 4,210 %, fällig 20.04.2028		423	Lloyds Bank Plc, 6,500 %, fällig 17.09.2040		479
Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028		410	BAE Systems Plc, 4,125 %, fällig 08.06.2022		444
Deutsche Bank AG, 4,000 %, fällig 24.06.2026		398	Lloyds Bank Plc, 5,125 %, fällig 07.03.2025		431
Credit Agricole SA, 4,875 %, fällig 23.10.2029		397	HSBC Holdings Plc, 7,000 %, fällig 07.04.2038		428
United Kingdom Gilt, 0,625 %, fällig 22.10.2050		388	Morgan Stanley, 2,625 %, fällig 09.03.2027		427
Motability Operations Group Plc, Series EMTN, 4,875 %, fällig 17.01.2043		359	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.10.2024		404
Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027		356	Santander UK Plc, 3,875 %, fällig 15.10.2029		399
Netflix Inc, 3,875 %, fällig 15.11.2029		356	Volkswagen Financial Services NV, 1,625 %, fällig 30.11.2022		397
Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044		341	Glencore Finance Europe Ltd, 6,000 %, fällig 03.04.2022		370
Svenska Handelsbanken AB, 4,625 %, fällig 23.08.2032		340	Western Power Distribution East Midlands Plc, 5,250 %, fällig am 17.01.2023		361
British Telecommunications Plc, 3,125 %, fällig 21.11.2031		334	NIE Finance Plc, 5,875 %, fällig 01.12.2032		348
NIE Finance Plc, 5,875 %, fällig 01.12.2032		328	FCE Bank Plc, 2,727 %, fällig 03.06.2022		319
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 4,875 %, fällig 29.04.2032		288	Wells Fargo & Co, 1,375 %, fällig 30.06.2022		310
JPMorgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033		261	Cooperatieve Rabobank UA, Serie 2541, 4,000 %, fällig 19.09.2022		302
Morgan Stanley, 5,789 %, fällig 18.11.2033		250	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030		300
AT&T Inc, 7,000 %, fällig am 30.04.2040		240	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 2,850 %, fällig 25.05.2037		298
United Kingdom Gilt, 4,750 %, fällig 07.12.2038		239	Bank of America Corp, 1,667 %, fällig am 06.02.2029		297
Koninklijke KPN NV, 5,750 %, fällig 17.09.2029		233			
Metropolitan Life Global Funding I, 5,000 %, fällig 10.01.2030		230			
Lloyds Banking Group Plc, 6,625 %, fällig 02.06.2033		229			
PepsiCo Inc, 3,550 %, fällig 22.07.2034		229			
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040		229			
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co, 5,125 %, fällig 23.11.2052		228			
Danske Bank A/S, 4,625 %, fällig 13.04.2027		219			
United Kingdom Gilt, 1,750 %, fällig 07.09.2037		217			
PepsiCo Inc, 3,200 %, fällig 22.07.2029		210			
GSK Consumer Healthcare Capital UK Plc, 3,375 %, fällig 29.03.2038		210			
Vodafone Group Plc, 5,125 %, fällig 02.12.2052		207			
United Kingdom Gilt, 1,500 %, fällig 22.07.2026		197			
NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027		190			
McDonald's Corp, Serie gmtm, 3,750 %, fällig 31.05.2038		179			
Intesa Sanpaolo SpA, 2,625 %, fällig 11.03.2036		178			
Tesco Corporate Treasury Services Plc, 5,500 %, fällig 27.02.2035		169			
AT&T Inc, 4,375 %, fällig am 14.09.2029		168			
GreenSquareAccord Ltd, 5,250 %, fällig 30.11.2047		167			
Rentokil Initial Plc, 5,000 %, fällig am 27.06.2032		167			
Vonovia SE, 2,375 %, fällig 25.03.2032		166			
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 15.08.2042		152			
Crh Finance UK Plc, 4,125 %, fällig 02.12.2029		151			

FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		63.642	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		74.921
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		3.564	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		3.392
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032		3.466	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032		3.378
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.02.2032		3.309	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051		3.359
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051		3.200	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032		3.272
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.02.2032		2.516	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		3.055
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		1.956	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.11.2031		2.378
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027		1.716	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051		2.350
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042		1.662	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2032		2.305
Danske Bank A.S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028		1.527	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 28.02.2027		1.699
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2032		1.463	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 15.05.2042		1.486
United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032		1.291	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2032		1.456
United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2025		1.266	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 31.01.2027		1.352
DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Ewige Anleihe		1.246	DCP Midstream LP, Series A, 7,375 %, Ewige Anleihe		1.336
Credit Suisse Group AG, 144A, 9,750 %, fortwährend		1.110	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032		1.300
Warnermedia Holdings Inc, 144A, 5,141 %, fällig 15.03.2052		1.110	Societe Generale SA, 144A, 1,488 %, fällig am 14.12.2026		1.256
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.07.2027		1.109	United States Treasury Note/Bond, 1,500 %, fällig 15.02.2025		1.229
DNB Bank ASA, 144A, 2,968 %, fällig 28.03.2025		1.043	Blackstone Mortgage Trust Inc, 4,375 %, fällig 05.05.2022		1.110
ZF North America Capital Inc, 144A, 4,750 %, fällig am 29.04.2025		1.022	Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Ewige Anleihe		1.069
Banco Santander SA, 4,175 %, fällig 24.03.2028		1.002	Boeing Co/The, 3,100 %, fällig am 01.05.2026		1.063

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

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		9.080	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		7.951
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		857	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM		965
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		697	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		848
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029		689	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 31.05.2029		678
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		684	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		677

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		652	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		640
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		578	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		568
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		571	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		566
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		563	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		563
Russian Federal Bond – OFZ, 0,000 %, fällig 23.05.2029		561	Russian Federal Bond – OFZ, Serie 6224, 6,900 %, fällig 23.05.2029		561
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		510	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		507
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052		453	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		469
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 %		387	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 2,500 %		394
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		369	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 %		389
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052		365	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %		369
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029		349	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 30.04.2029		348
United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029		339	United States Treasury Note/Bond, 3,250 %, fällig 30.06.2029		344
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 %		292	United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.05.2028		330
Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig am 20.09.2051		258	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 31.10.2028		295
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033		238	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,500 %		292
			United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 31.01.2028		283

FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		3.643	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		3.677
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		139	TSMC Arizona Corp, 3,250 %, fällig 25.10.2051		162
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052		126	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2025		141
Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig am 23.03.2030		109	Marken & Spencer Plc, 3,750 %, fällig 19.05.2026		128
Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029		109	Anheuser-Busch InBev SA.NV, 3,700 %, fällig 02.04.2040		112
Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, fällig 11/03//2032		109	Vestas Wind Systems Finance BV, 1,500 %, fällig am 15.06.2029		97
SSE Plc, 4,000 %, fortwährend		108	Ball Corp, 1,500 %, fällig 15.03.2027		96
Prologis Euro Finance LLC, 3,875 %, fällig 31.01.2030		108	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027		90
Elia Transmission Belgium SA, 3,625 %, fällig 18.01.2033		107	JCDecaux SA, 1,625 %, fällig 07.02.2030		87
Schneider Electric SE, 3,375 %, fällig 13.04.2034		106	Iberdrola Finanzas SA, 1,375 %, fällig 11.03.2032		86
Orsted AS, 3,625 %, fällig 01.03.2026		106	Equinix Inc, 1,000 %, fällig 15.03.2033		82
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039		104	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031		78
Amprion GmbH, 3,971 %, fällig 22.09.2032		100	Prologis Euro Finance LLC, 1,000 %, fällig 06.02.2035		77
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig am 15.02.2029		98	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032		76
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 03, 4,750 %, fällig 04.07.2034		94	MPT Operating Partnership LP. MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031		76
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.02.2027		93	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052		75
Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031		88	Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051		75
Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028		86	AbbVie Inc, 3,200 %, fällig am 21.11.2029		66
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031		86	United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig am 15.01.2032		50
UnitedHealth Group Inc, 4,000 %, fällig 15.05.2029		86	Bristol-Myers Squibb Co, 3,400 %, fällig 26.07.2029		44
Toronto-Dominion Bank/The, 4,456 %, fällig am 08.06.2032		85			
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2029		84			
Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.03.2045		84			
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032		78			

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		107.788	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		107.828
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		33.455	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.01.2023		28.325
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,410 %, fällig 30.04.2024		16.189	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		22.743
Schwedische Staatsanleihe, 1,500 %, fällig 13.11.2023		14.362	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		21.147
Italienische Staatsanleihe, 0,950 %, fällig 15.02.2023		14.116	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,410 %, fällig 30.04.2024		16.185
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		12.895	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,410 %, fällig 30.04.2024		13.289
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		10.715	Schwedische Staatsanleihe, 1,500 %, fällig 13.11.2023		13.260
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		10.678	Italienische Staatsanleihe, 0,950 %, fällig 15.02.2023		13.129
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052		10.593	Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023		11.341
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051		9.692	Australia Government Bond, Serie 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022		10.651
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032		8.949	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2031		10.460
Kreditanstalt für Wiederaufbau, 0,250 %, fällig am 19.10.2023		8.627	Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023		9.946
Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023		8.202	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031		9.832
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,875 %, fällig 31.01.2024		8.187	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		8.171
United Kingdom Gilt, 0,750 %, fällig 22.07.2023		7.241	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,875 %, fällig 31.01.2024		8.087
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032		6.866	New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023		6.469
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023		6.690	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023		5.721
Schwedische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 01.06.2022		6.115	Schwedische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 01.06.2022		4.953
Ungarische Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 26.10.2022		5.855	Ungarische Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 26.10.2022		4.820
Province of Manitoba Canada, 2,450 %, fällig 02.06.2025		4.742	Malaysia Government Bond, Serie 0313, 3,480 %, fällig 15.03.2023		4.319
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032		4.606	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032		4.010
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047		4.102			
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052		4.025			
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052		3.527			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE		ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		649.150	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		619.336
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		155.937	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		211.299
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,837 %, fällig 30.04.2024		136.752	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,431 %, fällig 30.04.2024		136.583
United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.08.2032		126.893	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		109.772
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		97.391	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.07.2023		76.152
United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052		68.092	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.01.2023		57.143
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		42.932	United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052		56.145
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032		28.972	Korea Treasury Bond, Serie 3012, 1,500 %, fällig am 12.10.2030		53.218
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053		28.693	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		39.331
Peru Government Bond, 6,150 %, fällig 12.08.2032		25.491	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2031		24.745
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,656 %, fällig 31.01.2024		22.892	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050		23.188
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052		22.408	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,491 %, fällig 31.01.2024		22.835
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2031		20.894	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048		20.495
Colombian TES, Serie B, 7,250 %, fällig 26.10.2050		18.801	Mexican Bonos, Serie M 30, 8,500 %, fällig 18.11.2038		19.791
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 12.01.2052		17.890	Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig am 07.11.2047		19.053
New Zealand Government Bond, Serie 0551, 2,750 %, fällig 15.05.2051		16.570	Indonesia Treasury Bond, Serie FR71, 9,000 %, fällig 15.03.2029		17.925
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, fällig 14.03.2025		15.421	Bank of Montreal, 0,729 %, fällig 10.03.2023		17.155
Fannie Mae Pool 'MA4841', 5,000 %, fällig 12.01.2052		14.918	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17.03.2023		15.777
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052		14.618	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15.09.2023		15.737
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033		13.548	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07.07.2025		15.522

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE		ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		5.204	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		5.347
Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029		438	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026		351
Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029		436	Wynn Las Vegas LLC. Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025		346
Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029		418	Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029		339
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025		407	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025		290
Wynn Las Vegas LLC. Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025		400	First Quantum Minerals Ltd 6,500 %, fällig 01.03.2024		289
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027		395	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2027		235
MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031		366	Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031		230
LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027		349	Aethon United BR LP. Aethon United Finance Corp, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2026		216
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028		324	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028		215
Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2026		307	ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030		214
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026		306	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027		205
Cimpress PLC, 7,000 %, fällig 15.06.2026		293	Imperial Brands Finance PLC, 6,125 %, fällig 27.07.2027		201
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029		292	Vector Group Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 01.02.2029		194
First Quantum Minerals Ltd 6,500 %, fällig 01.03.2024		285	Speedway Motorsports LLC 4,875 %, fällig 01.11.2027		198
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025		272	Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.04.2025		188
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026		269	Graham Packaging Co Inc 7,125 %, fällig 15.08.2028		186
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030		267	FMG Resources August 2006 Pty Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.04.2031		183
Station Casinos LLC, 144A, 4,625 %, fällig 01.12.2031		261	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027		181
ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030		259	Avient Corp, 0,000 %, fällig 27.07.2029		179

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund

WICHTIGE KÄUFE		ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE		ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		163.567	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		162.812
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		28.628	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,764 %, fällig 30.04.2024		25.352
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,764 %, fällig 30.04.2024		25.371	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		24.250
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		19.309	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		21.542
Italienische Staatsanleihe, 0,950 %, fällig 15.03.2023		16.054	Republic of Poland Government Bond, Serie 1023, 4,000 %, fällig 25.10.2023		20.023
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052		12.719	Italienische Staatsanleihe, 0,950 %, fällig 15.03.2023		15.117
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,824 %, fällig 31.01.2024		12.084	Australia Government Bond, Serie 128, 5,750 %, fällig 15.07.2022		14.727
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,936 %, fällig 31.01.2025		11.710	Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023		13.257
Schwedische Staatsanleihe, 1,500 %, fällig 13.11.2023		11.100	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,824 %, fällig 31.01.2024		12.064
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		11.054	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.11.2031		11.585
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051		10.742	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		10.203
United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052		10.381	Schwedische Staatsanleihe, 1,500 %, fällig 13.11.2023		10.065
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032		10.344	United Kingdom Gilt, 0,250 %, fällig 31.07.2031		9.829
Ginnie Mae II Pool 'MA8348', 5,000 %, fällig 20.10.2052		9.474	New Zealand Government Bond, Serie 0423, 5,500 %, fällig 15.04.2023		9.229
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023		7.922	Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 4,000 %, fällig 03.01.2023		8.420
Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032		7.615	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,000 %, fällig 15.08.2023		7.681
Bonos de la Tesoreria de la Republica en Pesos, 4,000 %, fällig 03.01.2023		7.338	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050		7.674
Schwedische Staatsanleihe, 3,625 %, fällig 01.06.2022		6.542	Schwedische Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 01.06.2022		6.320
Ungarische Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 26.10.2022		6.396	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15.09.2023		5.415
			Ungarische Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 26.10.2022		5.403

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Norway Government Bond, Serie 475, 144A, 2,000 %, fällig 24.05.2023	5.453	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07.07.2025	5.263
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052	5.438		
United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	5.162		

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	1.029.926	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	985.261
United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	207.370	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	375.171
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	181.625	United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	187.285
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2, 2,337 %, fällig 25.10.2030	135.941	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,136 %, fällig 31.07.2024	102.299
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,938 %, fällig 31.07.2024	102.323	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	67.171
United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	68.271	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	60.740
Französische Staatsanleihe, 1,750 %, fällig 25.05.2023	66.205	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2027	52.588
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTFN, 10,000 %, fällig 01.01.2023	44.074	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	27.834
Freddie Mac STACR Trust 2019-HQA2, Serie 2019 HQA2, Klasse M2, 144A, 6,667 %, fällig 25.04.2049	40.724	United Kingdom Treasury, 1,250 %, fällig 31.07.2051	27.271
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031	39.038	Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052	26.369
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	35.823	JP Morgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033	23.388
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	33.429	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2020-HQA2, Serie 2020 HQA2, Klasse M2, 144A, 3,287 %, fällig 25.03.2050	22.027
United Kingdom Treasury, 1,250 %, fällig 31.07.2051	30.528	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C03, Klasse 1M2C, 2,337 %, fällig 25.10.2030	17.961
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052	27.004	Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Series 137, 0,100 %, fällig 20.09.2023	17.242
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,800 %, fällig 15.08.2053	25.155	United States Treasury IL, 0,125 %, fällig 15.02.2052	16.900
Ginnie Mae II Pool 'MA8646', 4,500 %, fällig 20.02.2053	23.778	The Bank of America Corp, 4,571 %, fällig 27.04.2033	16.319
JP Morgan Chase & Co, 4,912 %, fällig 25.07.2033	22.269	Hercules Capital Inc, 2,625 %, fällig 16.09.2026	15.365
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 09.01.2052	20.946	Western Digital Corp, 1,500 %, fällig 01.02.2024	14.441
United States Treasury IL, 0,125 %, fällig 15.02.2052	17.874	Towd Point Mortgage Trust 2016-2, Serie 2016 2, Klasse B2, 144A, 3,401 %, fällig 25.08.2055	14.246
Französische Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 25.05.2052	17.189	Oaktown Re V Ltd, Series 2020 2A, Class M1B, 144A, 8,106 %, fällig 25.10.2030	13.109

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	41.335	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	41.044
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	9.420	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 2,046 %, fällig 30.04.2024	9.035
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	4.827	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023	7.564
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 12.01.2052	2.567	American Credit Acceptance Receivables Trust 2019-3, Serie 2019 3, Klasse F, 144A, 5,420 %, fällig 12.05.2026	2.416
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M1, 144A, 5,334 %, fällig 25.11.2041	1.958	STACR Trust 2018-HRP1, Series 2018 HRP1, Class B1, 144A, 3,937 %, fällig 25.04.2043	2.003
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R06, Series 2019 R06, Class 2B1, 144A, 8,367 %, fällig 25.09.2039	1.906	Westlake Automobile Receivables Trust 2020-3, Serie 2020 3A, Klasse D, 144A, 1,650 %, fällig 17.02.2026	1.899
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class M2, 144A, 6,584 %, fällig 25.10.2033	1.884	Santander Drive Auto Receivables, 1,640 %, fällig 16.11.2026	1.751
STACR Trust 2018-HRP2, Series 2018 HRP2, Class B1, 144A, 8,817 %, fällig 25.02.2047	1.852	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 3,743 %, fällig 25.07.2046	1.436
Santander Drive Auto Receivables, 1,640 %, fällig 16.11.2026	1.761	Freddie Mac STACR Trust 2019-HRP1, 6,500 %, fällig 25.02.2049	1.409
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04, Series 2019 R04, Class 2B1, 144A, 9,867 %, fällig 25.06.2039	1.714	Egypt Government Bond, Series INBK, 3,810 %, fällig 14.09.2050	1.353
GC Pastor Hipotecario 5 FTA 5, Class A2, 2,233 %, fällig 21.06.2046	1.703	Atrium XIV LLC 14A, Class E, 144A, 5,891 %, fällig 23.08.2030	1.239
Fannie Mae Pool 'MA4876', 6,000 %, fällig 12.01.2052	1.568	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2042	1.210
Freddie Mac Pool 'SD8278', 6,000 %, fällig am 12.01.2052	1.558	BlueMountain CLO XXII Ltd, 2,189 %, fällig 15.07.2031	1.179
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2016 C07, Class 2M2, 8,967 %, fällig 25.05.2029	1.460	Octagon Investment Partners 37 Ltd, Serie 2018 2A, Klasse D, 144A, 5,658 %, fällig 25.07.2030	1.080
FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 3,743 %, fällig 25.07.2046	1.448	LSTAR Commercial Mortgage Trust 2017-5, Series 2017 5, Class D, 144A, 4,676 %, fällig 10.03.2050	1.063
Viking Cruises Ltd, 144A, 13,000 %, fällig 15.05.2025	1.399	FREMF 2013-K29 Mortgage Trust VAR, 3,471 %, fällig 25.05.2046	1.009
Freddie Mac STACR Trust 2019-HRP1, 6,500 %, fällig 25.02.2049	1.399	Barings CLO Ltd 2018-II, Serie 2018 2X, Klasse D, 5,791 %, fällig 15.04.2030	996
Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1B1, 8,167 %, fällig 25.07.2030	1.339	WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-LC14, Serie 2014 LC14, Klasse D, 144A, 4,586 %, fällig 15.03.2047	948
BlueMountain CLO XXII Ltd, 2,189 %, fällig 15.07.2031	1.290	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Serie 2018 C01, Klasse 1M2, 6,867 %, fällig 25.07.2030	898
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA4, Series 2020 DNA4, Class B1, 144A, 10,617 %, fällig 25.08.2050	1.281	FREMF 2013-K31 Mortgage Trust VAR, 5,500 %, fällig 25.07.2046	869
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2042	1.190		
Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 8,717 %, fällig 25.07.2039	1.056		

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	5.227	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse	5.698
Wynn Las Vegas LLC. Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	431	Wynn Las Vegas LLC. Wynn Las Vegas Capital Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2025	358
Black Knight InfoServ LLC, 144A, 3,625 %, fällig am 01.09.2028	412	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	260
Uber Technologies Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.05.2025	364	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	207
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 2,800 %, fällig am 21.07.2023	338	Imperial Brands Finance Plc, 6,125 %, fällig 27.07.2027	201
Playtika Holding Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.03.2029	330	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 7,125 %, fällig 31.01.2025	200

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
TransDigm Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2026		325	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2027		199
Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027		290	Station Casinos LLC, 4,625 %, fällig 12.01.2031		195
LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027		270	Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029		186
Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029		247	Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig am 01.08.2026		185
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029		243	Geopark Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 17.01.2027		181
MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031		240	Amaggi Luxembourg International Sarl, 5,250 %, fällig 28.01.2028		179
Turning Point Brands Inc, 144A, 5,625 %, fällig am 15.02.2026		240	Alcoa Nederland Holding BV, 4,125 %, fällig 31.03.2029		179
Horizon Therapeutics USA Inc, 144A, 5,500 %, fällig am 01.08.2027		230	First Quantum Minerals Ltd, 6,875 %, fällig 15.10.2027		179
Mativ Holdings Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.10.2026		219	ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig am 27.04.2026		176
ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028		214	XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026		174
Freedom Mortgage Corp, 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026		213	Ardagh Packaging Finance Plc / Ardagh Holdings USA Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2026		170
Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig am 30.06.2030		210	Icahn Enterprises LP / Icahn Enterprises Finance Corp, 6,250 %, fällig am 15.05.2026		168
Lenovo Group Ltd, 144A, 6,536 %, fällig 27.07.2032		200	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig am 15.07.2031		166
New Fortress Energy Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2025		199	AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig am 31.05.2030		165

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,260 %, fällig 30.04.2024		17.051	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,120 %, fällig 31.10.2023		23.656
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,370 %, fällig 31.10.2023		15.660	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,260 %, fällig 30.04.2024		17.039
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		12.711	Republic of Poland Government Bond, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032		8.053
French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		4.993	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 3,334 %, fällig 31.07.2024		5.154
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 30.06.2032		3.747	French Republic Government Bond OAT, 0,000 %, fällig 25.05.2032		4.646
Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030		3.290	Anleihe der Russischen Föderation – OFZ, Series 6228, 7,650 %, fällig 10.04.2030		3.290
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,320 %, fällig 31.01.2024		2.606	Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042		3.200
Freddie Mac Pool 'SD8277', 5,500 %, fällig am 12.01.2052		2.595	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,320 %, fällig 31.01.2024		2.604
Fannie Mae Pool 'MA4842', 5,500 %, fällig 12.01.2052		2.202	Republic of South Africa Government Bond, Serie 2048, 8,750 %, fällig 28.02.2048		2.356
French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052		1.890	Commonwealth Bank of Australia, 144A, 0,449 %, fällig 07.07.2025		2.153
Fannie Mae Pool 'MA4841', 4,500 %, fällig 12.01.2052		1.713	Bank of Nova Scotia/The, 0,599 %, fällig 15.09.2023		2.099
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 09.01.2052		1.570	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 0,064 %, fällig 31.07.2023		2.063
Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,151 %, fällig 14.03.2025		1.466	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2029		1.878
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052		1.428	Capital One Financial Corp, 0,740 %, fällig am 06.12.2024		1.864
Macquarie Group Ltd, 144A, 6,207 %, fällig 22.11.2024		1.370	Canadian Imperial Bank of Commerce, 0,849 %, fällig 17.03.2023		1.831
Jackson National Life Global Funding, 144A, 5,613 %, fällig 28.06.2024		1.340	Athene Global Funding, 144A, 0,750 %, fällig 24.05.2024		1.746
United States Treasury Floating Rate Note – When Issued, 4,936 %, fällig 31.01.2025		1.281	National Australia Bank Ltd, 144A, 0,429 %, fällig am 12.01.2025		1.689
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,700 %, fällig 01.11.2024		1.269	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052		1.614
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		1.197	Malaysia Government Bond, Serie 0117, 3,882 %, fällig 10.03.2022		1.607
Mexican Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig am 13.11.2042		1.064	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		1.574
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052		1.050	French Republic Government Bond OAT, 0,750 %, fällig 25.05.2052		1.561
			Korea Treasury Bond, Serie 3106, 2,000 %, fällig am 06.10.2031		1.560
			Caterpillar Financial Services Corp, 0,200 %, fällig 17.11.2022		1.397
			Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2031		1.319
			Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 0,619 %, fällig 13.01.2023		1.310
			Czech Republic Government Bond, Serie 138, 1,750 %, fällig 23.06.2032		1.186

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,369 %, fällig 31.07.2024		1.498	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe, 4,354 %, fällig 31.07.2024		1.498
Freddie Mac Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2022 HQA2, Class M1B, 144A, 8,484 %, fällig 25.07.2042		592	Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Series 137, 0,100 %, fällig 20.09.2023		373
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1M2, 144A, 6,384 %, fällig 25.12.2041		561	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032		331
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA7, Series 2021 DNA7, Class M2, 144A, 6,284 %, fällig 25.11.2041		560	Französische Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 25.05.2032		329
Colombian TES, Serie B, 7,000 %, fällig 26.03.2031		441	Italienische Staatsanleihe, 2,500 %, fällig 01.12.2032		223
Mexican Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053		429	Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032		183
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNFF, 10,000 %, fällig 01.01.2033		421	Verizon Communications Inc, 1,450 %, fällig 20.03.2026		149
Japanische 5-jährige Staatsanleihe, Series 137, 0,100 %, fällig 20.09.2023		373	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands, 3,150 %, fällig 01.10.2026		149
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032		343	Air Canada, 3,875 %, fällig 15.08.2026		145
Französische Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 25.05.2032		341	Commscope Inc, 6,000 %, fällig 01.03.2026		110
Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 09.01.2052		333	Blackstone Private Credit Fund, 2,625 %, fällig 15.12.2026		108
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M1, 144A, 6,484 %, fällig 25.03.2042		259	Peruaise Staatsanleihe, 5,350 %, fällig 12.08.2040		69
Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052		241	Peru Government Bond, 6,150 %, fällig 12.08.2032		66
Italienische Staatsanleihe, 2,500 %, fällig 01.12.2032		227	Playtika Holding Corp, 4,250 %, fällig 15.03.2029		63
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,875 %, fällig am 15.10.2027		212	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M1, 144A, 6,484 %, fällig 25.03.2042		13
Var Energi ASA, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2028		207	Mileage Plus Holdings LLC / Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd, 144A, 6,500 %, fällig am 20.06.2027		8
AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig am 31.05.2030		204	Alaska Airlines 2020-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 4,800 %, fällig 15.08.2027		6
			Fannie Mae Pool 'MA4733', 4,500 %, fällig 09.01.2052		2
			Freddie Mac Pool 'SD8245', 4,500 %, fällig am 09.01.2052		2

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
XP Inc, 144A, 3,250 %, fällig 01.07.2026		202	Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig am 10.01.2052		1
Kenbourne Invest SA, 6,875 %, fällig am 26.11.2024		202			
UBS AG.London, 144A, 0,700 %, fällig 09.08.2024		200			
Export-Import Bank of India, 144A, 5,500 %, fällig 18.01.2033		200			
Stellantis NV, 5,250 %, fällig am 15.04.2023		200			
BRF SA, 144A, 3,950 %, fällig 22.05.2023		199			
Goldman Sachs Group Inc/The, 0,855 %, fällig 12.02.2026		198			
Arab Petroleum Investments Corp, 144A, 1,483 %, fällig 06.10.2026		197			
NatWest Group Plc, 2,359 %, fällig 22.05.2024		197			
FedEx Corp, 0,450 %, fällig 04.05.2029		191			
Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032		191			
Volvo Car AB, 2,500 %, fällig 07.10.2027		188			
Vestas Wind Systems Finance BV, 2,000 %, fällig 15.06.2034		188			
BNP Paribas SA, 0,375 %, fällig 14.10.2027		187			
International Bank for Reconstruction & Development, 5,000 %, fällig 22.01.2026		187			
JPMorgan Chase & Co, 0,768 %, fällig 09.08.2025		185			
General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032		185			
Micron Technology Inc, 2,703 %, fällig 15.04.2032		184			
International Bank for Reconstruction & Development, 4,250 %, fällig 22.01.2026		181			

FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		578	Goldman Sachs US\$ Liquid Reserves Fund – Institutionelle Klasse		616
iShares Russell 1000 Value ETF – ETF		123	Cigna Corp		118
Cisco Systems Inc		116	Nucor Corp		107
Applied Materials Inc		97	Applied Materials Inc		106
3M Co		86	American Express Co		102
Union Pacific Corp		85	AT&T Inc		100
American Express Co		83	Bank of America Corp		96
Target Corp		82	Wells Fargo & Co		90
Chubb Ltd		80	Goldman Sachs Group Inc/The		86
AT&T Inc		78	Micron Technology Inc		84
Micron Technology Inc		77	US Bancorp		77
Wells Fargo & Co		72	Anthem Inc		73
Caterpillar Inc		71	iShares Russell 1000 Value ETF – ETF		72
Kroger Co/The		66	Morgan Stanley		68
Morgan Stanley		65	Steel Dynamics Inc		60
Travelers Cos Inc/The		64	JPMorgan Chase & Co		59
American International Group Inc		63	Dollar Tree Inc		56
Pioneer Natural Resources Co		58	Broadcom Inc		55
KLA Corp		56	Citigroup Inc		53
Laboratory Corp of America Holdings		55	MetLife Inc		50
Tyson Foods Inc 'A'		50	Allstate Corp/Die		49
Cigna Group/The		49	Dr Horton Inc		47
Aflac Inc		47	Quest Diagnostics Inc		43
Broadcom Inc		46	Mohawk Industries Inc		43
Dr Horton Inc		46	Lennar Corp		39
Ameriprise Financial Inc		45			
FedEx Corp		44			

FTGF ClearBridge Value Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Meta Platforms Inc 'A'		30.292	Pioneer Natural Resources Co		31.815
American Electric Power Co Inc		23.539	Pfizer Inc		22.816
Pfizer Inc		22.532	Cigna Corp		22.435
Royal Gold Inc		21.896	Devon Energy Corp		21.233
Baker Hughes Co 'A'		19.499	DXC Technology Co		18.527
M&T Bank Corp		17.848	Charles Schwab Corp/The		16.441
Goldman Sachs Group Inc/The		17.121	General Electric Co		16.200
Noble Corp Plc		16.918	Medtronic Plc		15.908
Constellation Energy Corp		16.741	Intercontinental Exchange		15.791
Hess Corp		15.890	Enphase Energy Inc		15.280
CVS Health Corp		15.676	Synchrony Financial		14.838
Micron Technology Inc		15.327	EQT Corp		14.520
APA Corp		14.967	Bank of New York Mellon Corp/The		14.352
Intercontinental Exchange		14.432	Quanta Services Inc		13.980
Airbus SE		14.406	Alphabet Inc		13.700
Capital One Financial Corp		14.353	Cisco Systems Inc/Delaware		13.558
AstraZeneca Plc ADR		13.157	Gilead Sciences Inc		13.370
Biogen Inc		13.030	Schlumberger Ltd		12.684
Mosaic Co/The		12.016	Safran SA		11.296
MGIC Investment Corp		10.965	Unum Group		11.275
Horizon Therapeutics Plc		10.561	AbbVie Inc		10.684
Sensata Technologies Holding Plc		10.445	Vertex Pharmaceuticals Inc		9.876
Black Knight Inc		9.564	Wells Fargo & Co		9.615
Expedia Group Inc		8.903	UnitedHealth Group Inc		9.451
Las Vegas Sands Corp		8.726	Alibaba Group Holdings		8.760

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Value Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Everest Re Group Ltd	8.673		American Electric Power Co Inc	8.534	
Alcoa Corp	8.626		Splunk Inc	8.510	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	8.580		Meta Platforms Inc 'A'	8.450	
Alibaba Group Holdings	8.454		Horizon Therapeutics Plc	8.247	
SolarEdge Technologies Inc	8.115		Simon Property Group Inc	8.073	
Siemens AG	7.894		Sony Group Corp ADR	7.788	
BioNTech SE ADR	7.833		Goldman Sachs Group Inc/The	7.323	
Cigna Corp	7.663		Capri Holdings Ltd	6.995	
Bank of America Corp	7.629		GXO Logistics Inc	6.339	
United Airlines Holdings Inc	7.152		Melco Resorts & Entertainment Ltd ADR	6.207	
Tenet Healthcare Corp	6.686		Volkswagen AG	6.167	
Haleon Plc	6.571		American International Group Inc	5.872	
Schlumberger Ltd	6.316		OneMain Holdings Inc	5.714	
Oracle Corp	6.109		XPO Logistics Inc	5.666	

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Walmart Inc	2.289		Apple Inc	2.315	
Emerson Electric Co	1.701		Home Depot Inc/The	2.313	
Stryker Corp	1.293		Microsoft Corp	2.105	
Costco Wholesale Corp	1.134		Alphabet Inc	2.083	
NVIDIA Corp	1.015		JPMorgan Chase & Co	1.877	
Progressive Corp/The	831		Meta Platforms Inc 'A'	1.696	
Becton Dickinson and Co	823		Alphabet Inc 'A'	1.685	
AbbVie Inc	722		Cisco Systems Inc/Delaware	1.603	
Alphabet Inc 'A'	636		Toll Brothers Inc	1.372	
TJX Cos Inc/The	570		Fidelity National Information Services Inc	1.360	
PayPal Holdings Inc	569		salesforce.com Inc	1.217	
Sempra Energy	526		Travelers Cos Inc/The	1.155	
Meta Platforms Inc 'A'	521		Enphase Energy Inc	1.115	
Intercontinental Exchange Inc	517		Thermo Fisher Scientific Inc	951	
Eaton Corp Plc	511		Comcast Corp	929	
Amazon.com Inc	474		Amazon.com Inc	889	
CME Group Inc	473		Medtronic Plc	821	
Hartford Financial Services Group Inc/The	463		Texas Instruments Inc	803	
Microsoft Corp	446		PPG Industries Inc	766	
T-Mobile US Inc	427		Truist Financial Corp	677	
NextEra Energy Inc	422		Arista Networks Inc	609	
Berkshire Hathaway Inc	418		Hartford Financial Services Group Inc/The	598	
Oracle Corp	408		SVB Financial Group	527	
Adobe Inc	402		Adobe Inc	463	
Marriott International Inc/MD	383		ASML Holding NV	446	
McCormick & Co Inc/MD	380		UnitedHealth Group Inc	358	
Kinder Morgan Inc	378				
Apple Inc	360				
Vulcan Materials Co	334				
American Tower Corp	278				
Truist Financial Corp	256				

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Zoetis Inc	3.2105		CVS Health Corp	36.298	
Stryker Corp	25.838		Amazon.com Inc	35.292	
Sherwin-Williams Co/The	24.536		Meta Platforms Inc 'A'	29.204	
Marsh & McLennan Cos Inc	21.970		Palo Alto Networks Inc	28.381	
Intel Corp	20.760		Tractor Supply Co	27.127	
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'	20.174		Ulta Beauty Inc	26.219	
Microsoft Corp	19.534		Adobe Inc	25.765	
NextEra Energy Inc	14.474		UnitedHealth Group Inc	25.258	
Netflix Inc	11.966		Microsoft Corp	22.983	
PayPal Holdings Inc	9.115		Salesforce Inc	22.385	
NIKE Inc	8.943		Booking Holdings Inc	21.810	
Tesla Inc	7.304		Thermo Fisher Scientific Inc	21.231	
Dexcom Inc	7.283		Walt Disney Co/The	19.501	
Visa Inc 'A'	6.260		United Parcel Service Inc 'B'	18.853	
ASML Holding NV	6.035		NVIDIA Corp	18.091	
Alcon Inc	5.603		Apple Inc	17.885	
S&P Global Inc	5.204		NXP Semiconductors NV	17.295	
Intuitive Surgical Inc	5.131		Visa Inc 'A'	16.866	
Monster Beverage Corp	4.293		Fidelity National Information Services Inc	15.662	
Eaton Corp Plc	4.222		WW Grainger Inc	13.007	
Amazon.com Inc	2.898		BioMarin Pharmaceutical Inc	10.468	
Splunk Inc	2.896		Honeywell International Inc	9.625	
			Netflix Inc	8.784	
			S&P Global Inc	8.660	
			Monster Beverage Corp	8.198	
			Advance Auto Parts Inc	7.381	
			Zoetis Inc	6.494	

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

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Airbnb Inc	6.532	Vertex Pharmaceuticals Inc	31.332
Diageo Plc ADR	6.114	Twitter Inc	29.194
Snowflake Inc	3.696	UnitedHealth Group Inc	24.712
Doximity Inc	3.351	Broadcom Inc	18.491
Freemport-McMoRan Inc	3.184	Comcast Corp	17.097
HubSpot Inc	2.024	TE Connectivity Ltd	16.885
Autodesk Inc	2.007	Biogen Inc	14.034
AbbVie Inc	1.885	Wolfspeed Inc	13.770
Crowdstrike Holdings Inc	1.866	Warner Bros Discovery Inc	7.174
Accenture Plc 'A'	1.847	Autodesk Inc	6.791
Charles River Laboratories International Inc	1.725	Seagate Technology Holdings Plc	6.232
Etsy Inc	1.293	Johnson Controls International plc	6.184
Lyft Inc	471	Madison Square Garden Sports Corp	6.075
Match Group Inc	459	Meta Platforms Inc 'A'	5.913
Meta Platforms Inc 'A'	405	Ionis Pharmaceuticals Inc	4.945
		AMC Networks Inc	4.777
		Liberty Media Corp-Liberty SiriusXM	4.479
		Liberty Broadband Corp	4.375
		Dolby Laboratories Inc 'A'	4.165
		HubSpot Inc	3.719
		Crowdstrike Holdings Inc	3.669
		Madison Square Garden Entertainment Corp	3.576
		Etsy Inc	3.401
		Match Group Inc	3.252
		Western Digital Corp	3.195
		Insulet Corp	3.074
		AbbVie Inc	3.051

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Williams Cos Inc/The	406	Apple Inc	826
AGNC Investment Corp	399	Diamondback Energy	478
Healthcare trust of America	394	TriplePoint Venture Growth BDC Corp	403
Chord Energy Corporation	382	NortonLifeLock Inc	331
Rio Tinto Plc	331	Healthcare Realty Trust	328
Rocket Cos Inc	326	Chord Energy Corp	304
L3Harris Technologies Inc	205	Broadcom Inc, Series A	301
PPL Corp	202	Intel Corp	294
ConocoPhillips	198	Rio Tinto Plc	289
Union Pacific Corp	189	Rocket Cos Inc	289
Blackstone Inc	183	Progressive Corp/The	284
Trinity Capital Inc	179	South Jersey Industries Inc	265
Pfizer Inc	149	QUALCOMM Inc	264
Intel Corp	141	Stanley Black & Decker Inc	242
Ares Capital Corp	130	Trinity Capital Inc	194
TE Connectivity Ltd	129	NXP Semiconductors NV	168
Gaming and Leisure Properties Inc	125	Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,250 %, fällig 15.06.2023	161
Otis Worldwide Corp	111	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	144
Global Medical REIT Inc	105	Cisco Systems Inc/Delaware	140
Oracle Corp	97	TE Connectivity Ltd	124
United Parcel Service Inc 'B'	90	Duke Realty Corp	71
Texas Instruments Inc	84	Brookfield Renewable Corporation	70
Brookfield Renewable Corp	70		
Huntsman Corp	60		
Bank of America Corp	60		
NXP Semiconductors NV	52		

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Alphabet Inc 'A'	47.498	Marriott International Inc/MD	37.035
Johnson & Johnson	34.788	Amazon.com Inc	34.550
Prologis Inc	28.174	NextEra Energy Inc	32.218
Brookfield Renewable Corp	27.843	Brookfield Renewable Corporation	28.818
NextEra Energy Partners LP	27.079	Hasbro Inc	25.840
ASML Holding NV	25.761	Workday Inc 'A'	20.812
Novo Nordisk A/S ADR	24.425	Gilead Sciences Inc	19.906
Microsoft Corp	24.118	Intel Corp	18.720
Accenture Plc 'A'	24.024	Hain Celestial Group Inc/The	18.697
Apple Inc	20.164	Enphase Energy Inc	17.379
Shoals Technologies Group Inc 'A'	19.551	Microsoft Corp	17.120
Etsy Inc	17.480	UnitedHealth Group Inc	14.703
Bloom Energy Corp 'A'	15.955	Apple Inc	14.332
UnitedHealth Group Inc	12.659	Progressive Corp/The	14.095
Bank of America Corp	12.155	Comcast Corp	13.779
Deere & Co	11.306	Lam Research Corp	12.266
First Republic Bank/CA	10.928	CVS Health Corp	11.803
Costco Wholesale Corp	9.923	Synopsis Inc	11.560
CVS Health Corp	9.845	McCormick & Co Inc/MD	7.742
Amazon.com Inc	9.658	Home Depot Inc/The	7.736

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Hartford Financial Services Group Inc/The		9.212	Danaher Corp		7.638
Morgan Stanley		9.105	Williams-Sonoma Inc		7.277
Ecolab Inc		8.983	Hartford Financial Services Group Inc/The		7.024
Visa Inc 'A'		8.674	BioMarin Pharmaceutical Inc		6.970
Regal Rexnord Corp		8.552	Costco Wholesale Corp		6.894
McCormick & Co Inc/MD		8.474	Thermo Fisher Scientific Inc		6.617
Progressive Corp/The		8.463	Bank of America Corp		6.357
Gilead Sciences Inc		8.372	SolarEdge Technologies Inc		5.692
Eaton Corp Plc		8.342			
Home Depot Inc/The		8.207			
Salesforce Inc		8.101			
Trex Co Inc		7.870			
Danaher Corp		7.755			
SolarEdge Technologies Inc		7.731			
Cisco Systems Inc		7.670			
TE Connectivity Ltd		7.555			
Progyny Inc		7.454			
Williams-Sonoma Inc		7.350			
Ball Corp		7.316			
Thermo Fisher Scientific Inc		7.128			
Booking Holdings Inc		7.001			

FTGF ClearBridge Global Growth Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Schlumberger Ltd		392	Schlumberger Ltd		483
Eli Lilly & Co		330	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR		343
Deutsche Telekom AG		229	United Rentals Inc		246
NextEra Energy Inc		212	Air Liquide SA		240
Target Corp		195	Apple Inc		240
Deere & Co		171	Waste Management Inc		223
Daiichi Sankyo Co Ltd		168	TE Connectivity Ltd		207
Alibaba Group Holding Ltd		165	Progressive Corp/The		199
SAP SE		163	L'Oreal SA		177
Tencent Holdings Ltd		161	ICON Plc		174
Haleon Plc		161	Insulet Corp		174
Estee Lauder Cos Inc/The 'A'		159	Canadian Pacific Railway Ltd		173
Stryker Corp		158	Marriott International Inc/MD		170
Iberdrola SA ADR		146	Ulta Beauty Inc		169
United Rentals Inc		145	United Parcel Service Inc 'B'		166
Sony Group Corp		142	AlA Group Ltd		162
Sysco Corp		136	Old Dominion Freight Line Inc		159
AbbVie Inc		133	Atlas Copco AB		140
Olympus Corp		130	Union Pacific Corp		139
Loblaw Cos Ltd		130	Diageo Plc ADR		137
Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd		128	TJX Cos Inc/The		136
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE		126	Bank of America Corp		127
RELX Plc		124	Intesa Sanpaolo SpA		120
Computershare Ltd		122	T-Mobile US Inc		119
Brambles Ltd		121	Canadian Imperial Bank of Commerce		118
Intercontinental Exchange Inc		121	Avantor Inc		115
Microsoft Corp		120	Amadeus IT Group SA		113
SolarEdge Technologies Inc		117	Thomson Reuters Corp		102
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR		116	Recruit Holdings Co Ltd		101
Vertex Pharmaceuticals Inc		111	Elastic NV		91
Straumann Holding AG		107	Amazon.com Inc		90
TravelSky Technology Ltd		104	adidas AG		89
AlA Group Ltd		102	Samsung Electronics Co Ltd		86
Aflac Inc		96	Alphabet Inc 'A'		86
Zai Lab Ltd ADR		86	MonotaRO Co Ltd		83
Netflix Inc		84	London Stock Exchange Group Plc		82
Union Pacific Corp		84	Ansell Ltd		76
Kroger Co/The		75	Marvell Technology Inc		75

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
NextEra Energy Inc		58.120	Enbridge Inc		45.466
American Tower Corp		50.978	Exelon Corp		40.475
TC Energy Corp		44.386	Sempra Energy		39.613
PPL Corp		43.009	Getlink SE		31.717
CSX Corp		40.056	Clearway Energy Inc 'C'		30.326
Public Service Enterprise Group Inc		39.293	Hydro One Ltd		29.601
Union Pacific Corp		38.993	CMS Energy Corp		25.310
Getlink SE		38.562	CSX Corp		25.185
Transurban Group		38.082	Union Pacific Corp		24.798
United Utilities Group Plc		36.644	CenterPoint Energy Inc		23.779
Southwest Gas Holdings Inc		36.447	Cheniere Energy Inc		23.133
Seyn Trent Plc		35.411	CMS Energy Corp		22.600
Sempra Energy		35.062	SBA Communications Corp 'A'		22.237
American Water Works Co Inc		34.931	Public Service Enterprise Group Inc		22.094

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
PG&E Corp	32.774	American Tower Corp	20.963
OGE Energy Corp	29.739	Constellation Energy Corp	19.754
Central Japan Railway Co	29.152	NextEra Energy Inc	18.986
Cheniere Energy Inc	29.034	Dominion Energy Inc	18.204
Hydro One Ltd	28.583	NextEra Energy Inc	16.876
Enbridge Inc	28.244	Crown Castle International Corp	15.732
Centrais Eletricas Brasileiras SA	26.898	Aena SME SA, 144A	15.251
Clearway Energy Inc 'C'	26.280	Eiffage SA	14.018
Constellation Energy Corp	25.928	National Grid Plc	13.959
SSE Plc	24.595	Ferrovial SA	13.924
East Japan Railway Co	22.356	CenterPoint Energy Inc	13.345
Aena SME SA, 144A	21.842	Southern Co/The	13.336
CenterPoint Energy Inc	21.116	Transurban Group	12.469
CMS Energy Corp	21.101	American Water Works Co Inc	12.132
Cellnex Telecom SA, 144A	21.045	United Utilities Group Plc	11.979
Terna – Rete Elettrica Nazionale	19.925	Crown Castle International Corp	11.779
Crown Castle International Corp	19.518	Cheniere Energy Inc	11.512
Atlas Arteria Ltd	18.127	PG&E Corp	10.705
Entergy Corp	17.688	CSX Corp	9.660
EDP – Energias de Portugal SA	17.379	Vinci SA	8.980
Gibson Energy Inc	17.287	Williams Cos Inc/The	8.728
Iberdrola SA	16.501	Southern Co/The	7.911
Pembina Pipeline Corp	13.104		
Ferrovial SA	12.749		
Exelon Corp	12.220		

Legg Mason ClearBridge Emerging Markets Infrastructure Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
China Merchants Port Holdings Co Ltd	54	Power Grid Corp of India Ltd	73
Centrais Eletricas Brasileiras SA	50	Metro Pacific Investments Corp	56
Perusahaan Gas Negara Tbk PT	41	Gujarat State Petronet Ltd	55
Aboitiz Power Corp	39	Shanghai International Port 'A'	51
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	32	Gujarat Gas Ltd	44
Indraprastha Gas Ltd	29	Container Corp Of India Ltd	38
EcoRodovias Infraestrutura e Logistica SA	26	GMexico Transportes SAB de CV, 144A	37
NTPC Ltd	24	Operadora De Sites Mexicanos SAB de CV	28
Cia Energetica de Sao Paulo	15	Jiangsu Expressway Co Ltd	23
IHS Holding Ltd	15	Shenzhen Expressway Corp Ltd	22
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	15	Jasa Marga Persero Tbk PT	17
ENN Energy Holdings Ltd	12	International Container Terminal Services Inc	17
China Longyuan Power Group Corp Ltd	11	China Resources Power Holdings Co Ltd	15
Airports of Thailand PCL	11	China Power International Development Ltd	13
Neoenergia SA	10	Malaysia Airports Holdings Bhd	7
Grupo Aeroportuario del Centro Norte SAB de CV 'B'	10	Indraprastha Gas Ltd	6
China Power International Development Ltd	8	Neoenergia SA	6
Guangdong Investment Ltd	8	CCR SA	6
China Resources Power Holdings Co Ltd	4	CFE Capital S de RL de CV	5
		CPFL Energia SA	5

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Enbridge Inc	43.293	Enbridge Inc	39.273
Williams Cos Inc/The	33.244	Williams Cos Inc/The	27.292
Crown Castle Inc	29.964	Crown Castle Inc	17.104
TC Energy Corp	26.137	Emera Inc	13.886
EDP – Energias de Portugal SA	23.699	Atlas Arteria Ltd	12.697
SSE Plc	23.686	Snam SpA	12.131
National Grid Plc	22.223	Red Electrica Corp SA	11.797
Iberdrola SA	21.402	United Utilities Group Plc	11.577
United Utilities Group Plc	21.242	National Grid Plc	11.539
Snam SpA	19.766	Brookfield Renewable Corporation	10.811
Public Service Enterprise Group Inc	18.438	SSE Plc	10.317
Red Electrica Corp SA	15.707	Getlink SE	10.090
Southern Co/The	15.636	Vinci SA	9.808
Atlas Arteria Ltd	15.497	Aena SME SA, 144A	9.451
West Japan Railway Co	15.257	Iberdrola SA	9.137
Emera Inc	14.920	Clearway Energy Inc 'C'	8.286
APA Group	13.995	FirstEnergy Corp	8.183
OGE Energy Corp	13.978	Constellation Energy Corp	8.142
American Tower Corp	12.986	NextEra Energy Partners LP	8.110
Transurban Group	12.981	Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV	7.239
Brookfield Renewable Corp	12.690	EDP – Energias de Portugal SA	6.858
NextEra Energy Partners LP	11.752	Southern Co/The	6.785
Pennon Group Plc	11.567	TC Energy Corp	6.741
Entergy Corp	11.511	Public Service Enterprise Group Inc	5.783
Enagas SA	11.411	Pembina Pipeline Corp	5.564
Pembina Pipeline Corp	10.724	Entergy Corp	4.841
Constellation Energy Corp	10.423	Transurban Group	4.559
Ferrovial SA	9.041	Engie Brasil Energia SA	3.999

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Engie Brasil Energia SA		8.884	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'		3.635
Clearway Energy Inc 'C'		8.865	Brookfield Renewable Corp		3.553
CPFL Energia SA		8.353	Atlas Arteria Ltd		3.434
Vinci SA		8.072			
Centrais Eletricas Brasileiras SA		7.994			
Italgas SpA		7.881			
Southwest Gas Holdings Inc		7.824			
Gibson Energy Inc		6.887			
Union Pacific Corp		6.775			
CCR SA		6.652			

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		190.962	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	200.330	
TTEC Holdings Inc		6.545	Sierra Wireless Inc		6.924
Artivion Inc		4.502	Digi International Inc		6.832
nLight Inc		4.374	LSB Industries Inc		6.428
Resources Connection Inc		3.994	IntriCon Corp		6.109
IAA Inc		3.690	Scorpio Tankers Inc		5.386
Healthcare Services Group Inc		3.673	Atlas Air Worldwide Holdings Inc		5.025
Allegiant Travel Co		3.600	Allegheny Technologies Inc		4.901
BWX Technologies Inc		3.540	Cross Country Healthcare Inc		4.777
Summit Materials Inc 'A'		3.448	Intrepid Potash Inc		4.650
IAC Inc		3.429	Arcosa Inc		4.571
First Bancshares Inc/The		3.208	Aerojet Rocketdyne Holdings Inc		4.528
MRC Global Inc		3.164	Univar Solutions Inc		4.339
Adient Plc		3.104	Owens & Minor Inc		4.209
Magnite Inc		3.081	Modine Manufacturing Co		4.174
Overstock.com Inc		3.056	AdvanSix Inc		4.153
Coherent Corp		2.845	Old Republic International Corp		4.116
NeoGenomics Inc		2.829	WESCO International Inc		4.066
TPI Composites Inc		2.770	JetBlue Airways Corp		4.007
Hub Group Inc 'A'		2.708	IAA Inc		3.874

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		21.425	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		21.804
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF		2.519	Meridian Bioscience Inc		2.619
FormFactor Inc		2.091	RLI Corp		2.506
RLI Corp		1.723	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF		2.377
MKS Instruments Inc		1.670	Catalyst Pharmaceuticals Inc		1.937
Bio-Techne Corp		1.623	Kulicke & Soffa Industries Inc		1.727
Enovis Corp		1.515	MasterCraft Boat Holdings Inc		1.647
IAA Inc		1.466	Cohu Inc		1.606
Forward Air Corp		1.206	Patrick Industries Inc		1.472
Skyline Champion Corp		1.201	Simulations Plus Inc		1.429
Brunswick Corp/DE		1.171	ChannelAdvisor Corp		1.415
Avid Technology Inc		1.164	Heidrick & Struggles International Inc		1.372
Ziff Davis Inc		1.154	Harmony Biosciences Holdings Inc		1.315
Carter's Inc		1.132	Arcosa Inc		1.293
Houlihan Lokey Inc 'A'		1.086	Inter Parfums Inc		1.292
Dun & Bradstreet Holdings Inc		1.046	Meritor Inc		1.264
Brady Corp 'A'		1.017	Vectrus Inc		1.127
Harmony Biosciences Holdings Inc		1.016	Natus Medical Inc		1.104
Louisiana-Pacific Corp		899	Innospec Inc		1.088
Hudson Technologies Inc		898	Gibraltar Industries Inc		1.066
Forrester Research Inc		846	Vishay Intertechnology Inc		935
Air Lease Corp 'A'		771	MKS Instruments Inc		902
Ironwood Pharmaceuticals Inc 'A'		761	Pason Systems Inc		873
LCI Industries		755	Avid Technology Inc		861
Leonardo DRS Inc		748	Air Lease Corp 'A'		861
FARO Technologies Inc		738	Insight Enterprises Inc		858
Heritage-Crystal Clean Inc		698	Great Lakes Dredge & Dock Corp		805
AMN Healthcare Services Inc		694	Ziff Davis Inc		797
Artisan Partners Asset Management Inc 'A'		688	IAA Inc		774
Inter Parfums Inc		677	Lazard Ltd 'A'		757
Kennedy-Wilson Holdings Inc		660	CMC Materials Inc		754

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		781	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		741
JCU Corp		96	Boa Vista Servicos SA		85
NICE Information Service Co Ltd		91	Kulicke & Soffa Industries Inc		71
Marlowe Plc		63	Bravura Solutions Ltd		69
Boa Vista Servicos SA		60	Alimak Group AB, 144A		65

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

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

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
IAA Inc	54	Technology One Ltd	55
FormFactor Inc	48	Morningstar Inc	53
BML Inc	47	Avid Technology Inc	47
Zuken Inc	46	Meridian Bioscience Inc	45
Enovis Corp	46	IPH Ltd	42
Intertek Group Plc	43	Dolby Laboratories Inc 'A'	40
Douzone Bizon Co Ltd	42	Meitec Corp	39
Esab Corp	40	UFP Industries Inc	39
FirstService Corporation	39	Hansen Technologies Ltd	36
DiscoverIE Group Plc	39	Comture Corp	36
OBIC Business Consultants Co Ltd	38	Arcosa Inc	35
LCI Industries	37	Landstar System Inc	35
Restore Plc	37	Innospec Inc	34
Learning Technologies Group Plc	34	Carel Industries SpA, 144A	34
XP Power Ltd	33	Altus Group Ltd/Canada	31
IPH Ltd	32	Odontoprev SA	30
UFP Industries Inc	31	Valmont Industries Inc	29
Dorman Products Inc	30	LCI Industries	27
TechTarget Inc	29	Quaker Chemical Corp	27
Quaker Chemical Corp	29	FormFactor Inc	27
MKS Instruments Inc	27	CMC Materials Inc	26
Colliers International Group Inc	25	Lincoln Electric Holdings Inc	26
Forrester Research Inc	25	Asseco Poland SA	26

Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Zurich Insurance Group AG	392	Roche Holding AG	1.017
		Novo Nordisk A/S	977
		Nestle SA	901
		Novartis AG	892
		Sanofi	737
		GlaxoSmithKline Plc	660
		BHP Group Ltd	567
		SAP SE	538
		BAE Systems Plc	514
		Allianz SE	487
		Rio Tinto Plc	486
		Unilever Plc	462
		Wolters Kluwer NV	426
		British American Tobacco Plc	425
		Galenica AG, 144A	424
		Bunzl Plc	423
		Orange SA	422
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	420
		Red Electrica Corp SA	413
		Enagas SA	401
		Swiss Re AG	399
		Carrefour SA	398
		Vodafone Group Plc	393
		Skandinaviska Enskilda Banken AB	385
		Zurich Insurance Group AG	377
		BP Plc	352
		SGS SA	351
		Koninklijke KPN NV	350
		Imperial Brands Plc	349
		Banque Cantonale Vaudoise	348
		NN Group NV	331
		Deutsche Post AG	329
		Direct Line Insurance Group Plc	327
		Telenor ASA	325
		Telefonica Deutschland Holding AG	313
		Kuehne + Nagel International AG	306
		PSP Swiss Property AG	303
		IG Group Holdings Plc	302
		Telefonica SA	302
		Vinci SA	300
		Yara International ASA	300
		Sage Group Plc/The	296
		Orion Oyj	293
		Ageas SA/NV	289
		Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	279
		Admiral Group Plc	277
		Eutelsat Communications SA	276
		Kingfisher Plc	276
		Telefonaktiebolaget LM Ericsson 'B'	269

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
BHP Group Ltd	454	Dali Foods Group Co Ltd, 144A	358
Coles Group Ltd	330	Yuexiu Property Co Ltd	339
Jardine Matheson Holdings Ltd	290	CLP Holdings Ltd	330
Petronas Chemicals Group Bhd	279	RHB Bank Bhd	289
Astra International Tbk PT	231	CTBC Financial Holding Co Ltd	262
United Tractors Tbk PT	228	CITIC Ltd	210
China Tower Corp Ltd, 144A	222	CGN Power Co Ltd, 144A	202
Woodside Energy Group Ltd	209	Fortune Real Estate Investment Trust	168
Kia Corp	190	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	167
United Microelectronics Corp	162	Infosys Ltd	148
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	113	KT Corp ADR	137
Adaro Energy Indonesia Tbk PT	112	China Shenhua Energy Co Ltd	135
		Longfor Group Holdings Ltd, 144A	132
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	126
		KT&G Corp	122
		Alia Group Ltd	121
		Jardine Cycle & Carriage Ltd	120
		Asustek Computer Inc	115
		China Construction Bank Corp	111
		NHPC Ltd	107
		Fu Shou Yuan International Group Ltd	97
		SK Hynix Inc	84
		PICC Property & Casualty Co Ltd	81
		Power Grid Corp of India Ltd	76
		CITIC Telecom International Holdings Ltd	71
		China Railway Group Ltd	70
		Indofood Sukses Makmur Tbk PT	70
		Astro Malaysia Holdings Bhd	64
		China Medical System Holdings Ltd	64
		Asia Cement Corp	62

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
UnitedHealth Group Inc	247	iShares MSCI ACWI ETF – ETF	582
Philip Morris International Inc	181	UnitedHealth Group Inc	270
McDonald's Corp	158	AbbVie Inc	238
Loblaw Companies Ltd	156	Johnson & Johnson	220
PPL Corp	155	iShares MSCI EAFE ETF – ETF	219
Western Union Co	120	SPDR S&P 500 ETF Trust – ETF	216
		Kroger Co/The	214
		Lockheed Martin Corp	201
		Broadcom Inc	200
		Amgen Inc	196
		Bristol-Myers Squibb Co	195
		Hershey Co/The	188
		Northrop Grumman Corp	186
		Philip Morris International Inc	183
		Sanofi	183
		Loblaw Companies Ltd	182
		Pfizer Inc	182
		Roche Holding AG	180
		Walmart Inc	180
		Cisco Systems Inc.Delaware	179
		Marubeni Corp	179
		PPL Corp	178
		Merck & Co Inc	177
		Cardinal Health Inc	176
		H&R Block Inc	174
		Home Depot Inc/The	172
		International Business Machines Corp	172
		KDDI Corp	172
		Nippon Telegraph & Telephone Corp	170
		CVS Health Corp	167
		HP Inc	167
		Intel Corp	167
		Rio Tinto Ltd	165
		Microsoft Corp	164
		Gilead Sciences Inc	163
		Target Corp	163
		McDonald's Corp	162
		Orange SA	158
		American Financial Group Inc/OH	156
		Altria Group Inc	153
		GlaxoSmithKline Plc	149
		Caterpillar Inc	148
		Postal Savings Bank of China Co Ltd, 144A	148
		Texas Instruments Inc	148
		Koninklijke Ahold Delhaize NV	147
		Nintendo Co Ltd	147
		Red Electrica Corp SA	145

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ - (Fortsetzung)

		ERLÖSE (in Tsd.) USD
	WICHTIGE VERKÄUFE	
	Simplo Technology Co Ltd	142
	J M Smucker Co/The	141
	Radiant Opto-Electronics Corp	141
	King Yuan Electronics Co Ltd	140
	Flowers Foods Inc	139
	Juniper Networks Inc	139
	Walgreens Boots Alliance Inc	139

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Singapore Telecommunications Ltd	635	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	1.111
Samsung Electronics Co Ltd	572	Tencent Holdings Ltd	981
JD.com Inc	401	Samsung Electronics Co Ltd	931
Hansol Chemical Co Ltd	379	United Overseas Bank Ltd	765
Accton Technology Corp	349	HDFC Bank Ltd	643
Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	274	AIA Group Ltd	606
LEENO Industrial Inc	250	Alibaba Group Holding Ltd	583
Tencent Holdings Ltd	219	Hero MotoCorp Ltd	554
JD.com Inc	200	Jardine Matheson Holdings Ltd	525
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	182	JD.com Inc	520
iShares Core MSCI Asia ex Japan ETF – ETF	147	Singapore Telecommunications Ltd	486
Alibaba Group Holding Ltd	131	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	452
CSPC Pharmaceutical Group Ltd	91	Venture Corp Ltd	449
LG Chem Ltd	63	Tata Consultancy Services Ltd	445
Venture Corp Ltd	62	Singapore Technologies Engineering Ltd	420
Feng TAY Enterprise Co Ltd	48	ENN Energy Holdings Ltd	400
Hero MotoCorp Ltd	43	LG Chem Ltd	382
LG Energy Solution Ltd	41	Feng TAY Enterprise Co Ltd	346
Jardine Matheson Holdings Ltd	38	TravelSky Technology Ltd	337
Singapore Technologies Engineering Ltd	37	LG Energy Solution Ltd	321
		Ping An Insurance Group Co of China Ltd	319
		Orion Corp/Republic of Korea	319
		Techtronic Industries Co Ltd	318
		Minth Group Ltd	317
		Tongcheng Travel Holdings Ltd	317
		Hansol Chemical Co Ltd	310
		Guangdong Investment Ltd	295
		Accton Technology Corp	254
		LEENO Industrial Inc	241
		Telkom Indonesia Persero Tbk PT	238
		LG H&H Co Ltd	236
		Shenzhen International Group Holdings Ltd	233
		Shandong Weigao Group Medical Polymer Co Ltd	230

FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund^

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
ASML Holding NV	12.104	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	9.708
Pernod Ricard SA	4.461	Microsoft Corp	3.848
NIKE Inc	4.120	Linde Plc	3.369
Zoetis Inc	3.692	ResMed Inc	3.296
Coloplast A/S	3.647	ASML Holding NV	3.210
Croda International Plc	3.128	NVIDIA Corp	3.137
Microsoft Corp	2.993	Tencent Holdings Ltd	3.035
Linde Plc	2.577	Kingspan Group Plc	2.750
NVIDIA Corp	2.577	Mastercard Inc	2.743
ResMed Inc	2.477	L'Oreal SA	2.557
Kingspan Group Plc	2.274	Coloplast A/S	2.377
Mastercard Inc	2.141	Moncler SpA	2.352
L'Oreal SA	2.140	Hexagon AB	2.337
Moncler SpA	2.057	CSL Ltd	2.335
Hexagon AB	1.881	Ferrari NV	2.266
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	1.876	adidas AG	2.236
Ferrari NV	1.837	Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A	2.150
CSL Ltd	1.785	Atlas Copco AB	2.067
Veeva Systems Inc 'A'	1.608	AIA Group Ltd	2.060
Assa Abloy AB	1.596	Assa Abloy AB	2.021

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund

	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD		ERLÖSE (in Tsd.) USD
WICHTIGE KÄUFE		WICHTIGE VERKÄUFE	
Chorus Ltd	878	NHPC Ltd	787
Fortune Real Estate Investment Trust	467	Vicinity Ltd	645
China Merchants Port Holdings Co Ltd	441	Manila Electric Co	628
Scentre Group	396	Fraser Centrepoint Trust	467
Aurizon Holdings Ltd	377	Digital Telecommunications Infrastructure Fund	359
China Tower Corp Ltd, 144A	311	Wharf Real Estate Investment Co Ltd	357
Transurban Group	253	Keppel DC REIT	310
Kiwi Property Group Ltd	250	Transurban Group	261
Link REIT	209	Waypoint REIT Ltd	252

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Guangdong Investment Ltd		174	APA Group		232
CLP Holdings Ltd		166	China Tower Corp Ltd, 144A		208
NHPC Ltd		149	Charter Hall Long Wale REIT		156
Capitalland India Trust		134	Chorus Ltd		141
Wharf Real Estate Investment Co Ltd		130	Contact Energy Ltd		90
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd		117	CapitaLand Integrated Commercial Trust		88
GPT Group/The		113	NETLINK NBN TRUST		54
Stockland		108	Power Grid Corp of India Ltd		40
Vicinity Ltd		78	Stockland		39
NETLINK NBN TRUST		78	CLP Holdings Ltd		39
Charter Hall Retail REIT		77	Scentre Group		38
Shopping Centres Australasia Property Group		77			
AGL Energy Ltd		71			
Contact Energy Ltd		65			

FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Wal-Mart de Mexico SAB de CV		783	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd		1.156
Grupo Financiero Banorte SAB de CV		715	Samsung Electronics Co Ltd		1.149
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd		706	Tencent Holdings Ltd		993
Samsung Electronics Co Ltd		658	OTP Bank Nyrt		819
ENN Energy Holdings Ltd		585	Titan Co Ltd		628
Wuxi Biologics Cayman Inc, 144A		556	Maruti Suzuki India Ltd		555
Tencent Holdings Ltd		499	Asian Paints Ltd		503
Globant SA		444	Alibaba Group Holding Ltd ADR		478
Shenzhen Inovance Technology Co Ltd		424	Meituan 'B', 144A		433
China Merchants Bank Co Ltd		411	UltraTech Cement Ltd		384
Alibaba Group Holding Ltd ADR		279	ICICI Bank Ltd		383
ICICI Bank Ltd		263	LG Chem Ltd		374
Al Rajhi Bank		257	Contemporary Amperex Technology Co Ltd		369
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		252	Reliance Industries Ltd		368
SK Hynix Inc		248	SK Hynix Inc		368
Reliance Industries Ltd		235	Prosus NV		355
WEG SA		222	Credicorp Ltd		341
Titan Co Ltd		212	Samsung SDI Co Ltd		334
Credicorp Ltd		207	AIA Group Ltd		320
B3 SA – Brasil Bolsa Balcao		200	NAVER Corp		282
AIA Group Ltd		199	EPAM Systems Inc		268
Meituan 'B', 144A		183	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT		264
HDFC Bank Ltd		183	HDFC Bank Ltd		264
JD.com Inc ADR		176	Ping An Insurance Group Co of China Ltd		255
Ping An Insurance Group Co of China Ltd		158	Al Rajhi Bank		249
Antofagasta Plc		156	JD.com Inc ADR		247
Cosan SA		155	Wuxi Lead Intelligent Equipment Co Ltd		226
Asian Paints Ltd		151	Cosan SA		224
Contemporary Amperex Technology Co Ltd		143	Antofagasta Plc		207
Ping An Bank Co Ltd		141	Kotak Mahindra Bank Ltd		199
Maruti Suzuki India Ltd		133	Globalwafers Co Ltd		196
Kotak Mahindra Bank Ltd		132	China Merchants Bank Co Ltd		191
JD.com Inc		131	Delivery Hero SE, 144A		181
EPAM Systems Inc		120	Wal-Mart de Mexico SAB de CV		170
			WEG SA		170
			B3 SA – Brasil Bolsa Balcao		160

FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN		WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE	
	(in Tsd.) USD			(in Tsd.) USD	
Pernod Ricard SA		6.040	ASML Holding NV		12.286
Croda International Plc		5.107	Linde Plc		7.985
Oxford Nanopore Technologies Plc		3.604	Ferrari NV		7.786
Coloplast A/S		3.152	Kering SA		7.577
Sartorius Stedim Biotech		1.889	Infineon Technologies AG		6.445
ASML Holding NV		1.485	Hexagon AB		6.328
Ferrari NV		1.198	adidas AG		6.315
Kingspan Group Plc		1.186	Mettler-Toledo International Inc		6.083
Dassault Systemes SE		1.099	Sartorius Stedim Biotech		5.362
L'Oreal SA		1.086	L'Oreal SA		5.349
Kering SA		972	Atlas Copco AB		5.207
Partners Group Holding AG		968	Moncler SpA		4.884
Linde Plc		922	Assa Abloy AB		4.810
Mettler-Toledo International Inc		916	Kingspan Group Plc		4.796
Nemetschek SE		889	Dassault Systemes SE		4.172
Hexagon AB		836	Partners Group Holding AG		3.555
Kerry Group Plc		778	Ambu A/S 'B'		3.505
Moncler SpA		756	Nemetschek SE		3.427
Assa Abloy AB		751	Coloplast A/S		3.038
Infineon Technologies AG		705	Kerry Group Plc		2.833
Allfunds Group Plc		628	Oxford Nanopore Technologies Plc		2.502
Atlas Copco AB		617	Allfunds Group Plc		2.259
adidas AG		529	Dr Martens Plc		1.203
			Farfetch Ltd		1.201

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Franklin Responsible Income 2028 Fund^

WICHTIGE KÄUFE	ANSCHAFFUNGSKOSTEN (in Tsd.) USD	WICHTIGE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) USD
Morgan Stanley, 4,813 %, fällig 25.10.2028	836	Lloyds Banking Group Plc	493
Caixa Geral de Depositos SA, 5,750 %, fällig 31.10.2028	836	CNP Assurances SA	410
JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig 18.05.2028	825	Microsoft Corp	399
Crelan SA, 5,750 %, fällig 26.01.2028	815	Santander Consumer Finance SA	353
ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, fällig 16.01.2028	807	Apple Inc, 2,000 %, fällig 17.09.2027	192
BPCE SA, 4,375 %, fällig am 13.07.2028	804	JPMorgan Chase & Co, 1,638 %, fällig 18.05.2028	182
Romanian Government International Bond, 2,125 %, fällig 07.03.2028	775	International Business Machines Corp, 0,300 %, fällig 11.02.2028	172
Orano SA, 2,750 %, fällig 08.03.2028	748	Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	168
Engie SA, 1,750 %, fällig 27.03.2028	742	Autostrade per l'Italia SpA	91
AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028	734		
Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig 20.03.2028	713		
Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, fällig 14.09.2028	711		
Commerzbank AG, 4,625 %, fällig 21.03.2028	704		
Sage Group Plc/The, 3,820 %, fällig 15.02.2028	703		
Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028	702		
La Banque Postale SA, 1,000 %, fällig 09.02.2028	702		
Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig 07.02.2029	701		
International Business Machines Corp, 0,300 %, fällig 11.02.2028	696		
Atlantia SpA, 1,875 %, fällig 12.02.2028	693		
CaixaBank SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028	691		
Thames Water Utilities Finance Plc, 0,875 %, fällig 31.01.2028	689		
Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	684		
Apple Inc, 2,000 %, fällig 17.09.2027	678		
CEZ AS, 3,000 %, fällig 05.06.2028	665		
Nationwide Building Society, 0,250 %, fällig 14.09.2028	665		
Vonovia Finance BV, 1,500 %, fällig 14.01.2028	616		
Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027	616		
RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	610		
NatWest Markets Plc, 4,250 %, fällig 13.01.2028	606		
easyJet FinCo BV, 1,875 %, fällig 03.03.2028	601		
Banco Santander SA, 3,875 %, fällig 16.01.2028	600		
Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 22.03.2028	597		
Nykredit Realkredit AS, 0,375 %, fällig 17.01.2028	586		
OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig 16.06.2028	581		
Berry Global Inc, 1,500 %, fällig 15.01.2027	575		
Credit Suisse Group AG, 0,650 %, fällig 14.01.2028	561		
Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig 15.07.2028	560		
PVH Corp, 3,125 %, fällig 15.12.2027	514		
Societe Generale SA, 0,125 %, fällig 18.02.2028	509		
National Grid Plc, 0,163 %, fällig 20.01.2028	507		
Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig 03.03.2028	500		
Lloyds Banking Group Plc	494		
Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,000 %, fällig 04.05.2028	470		
Matterhorn Telecom SA, 4,000 %, fällig 15.11.2027	465		
IQVIA Inc, 2,250 %, fällig 15.01.2028	443		
Rexel SA, 2,125 %, fällig 15.12.2028	440		
Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	437		
CNP Assurances SA	415		
Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027	408		
Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028	408		
Microsoft Corp	398		
Cloverie Plc für Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig am 15.12.2028	389		
Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig 25.08.2028	388		
DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027	383		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)

Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. („FTIS“), eine für OGAW zugelassene Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“), wendet eine Vergütungsrichtlinie (die „Richtlinie“) an, die für alle von ihr verwalteten OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und gemeinsam die „OGAW“) gilt. Die Richtlinie ist darauf ausgerichtet, das Eingehen übermäßiger Risiken zu verhindern. Die entsprechenden Performance-Managementsysteme umfassen Risikokriterien, die für die hiervon abgedeckten Geschäftsbereiche spezifisch sind. Die Governance-Struktur der Richtlinie zielt darauf ab, interne Interessenkonflikte zu verhindern.

Es wurden feste Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinien sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinien eingeführt. Sowohl die Geschäftsleitung als auch die Personalabteilung, die Compliance-Beauftragten und andere Abteilungen sind in dieses Verfahren eingebunden. Die Richtlinie wird von der Geschäftsführung und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich sonstiger Leistungen, zu denen Pensionsbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder Beiträge zur privaten Krankenversicherung zählen können. Die Höhe der festen Vergütung richtet sich nach der Komplexität der Tätigkeit, dem Verantwortungsniveau, der jeweiligen Leistung und der am Markt ermittelten Vergleichsdaten. Sie wird regelmäßig überprüft.

Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, langfristige Zusagen in Form von gewährten Performance-Anteilen oder Vertriebsbonuszahlungen. Die Höhe der variablen Vergütung richtet sich nach dem Gesamtergebnis des Unternehmens und des Geschäftsbereichs sowie nach der individuellen Leistung.

Die vollständige Richtlinie ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Quantitative Informationen, die für die Fonds relevant sind, sind nachfolgend aufgeführt:

Gesamtbetrag der festen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 gezahlt wurde*, **, ***	10.479.456 €
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 gezahlt wurde*, **, ***	7.036.351 €
Anzahl der Mitarbeiter von FTIS und seinen Beauftragten zum 30. September 2022	549
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 an die Geschäftsleitung gezahlt haben*, **, ***	5.321.053 €
Von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeiter, die während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 erheblichen Einfluss auf das OGAW-Profil hatten, gezahlter Gesamtbetrag*, **, ***	1.108.336 €

* Der von FTIS gezahlte Gesamtvergütungsbetrag wurde jedem OGAW auf Basis seines jeweiligen Anteils am durchschnittlichen Gesamtvermögen von FTIS zum Monatsende während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 zugerechnet.

** Der von den Beauftragten von FTIS gezahlte Gesamtvergütungsbetrag wurde jedem OGAW auf Basis seines jeweiligen Anteils am durchschnittlichen Gesamtvermögen der Beauftragten von FTIS zum Monatsende während des Geschäftsjahres zum 30. September 2022 zugerechnet.

*** 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)

In den folgenden Tabellen sind der Gesamt-Bruttonennwert für umgekehrte Pensionsgeschäfte und der absolute beizulegende Zeitwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, aufgeschlüsselt nach Gegenparteien, zum 28. Februar 2023 angegeben:

Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Summe Brutto-		% vom Nettoinventarwert
		Nominalwert (in Tsd.) USD	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) USD	
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	35.000	35.000	4,20
HSBC Bank (USA)	Vereinigtes Königreich	55.000	55.000	6,60
JP Morgan Securities LLC	USA	75.000	75.000	8,99
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	6,00
TD Securities (USA) LLC	Kanada	29.848	29.848	3,58
		244.848	244.848	29,37

In der folgenden Tabelle sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten basierend auf dem Wert der erhaltenen unbaren Sicherheiten und die Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 28. Februar 2023 aufgeführt:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	USA**	US-Dollar	249.766\$

* Wenn zum 28. Februar 2023 weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten vorhanden waren, wurden alle Emittenten aufgenommen.

** Die zugrundeliegende Anleihe, die als Sicherheit gehalten wird, wird vom United States Treasury ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Aufgliederung der erhaltenen unbaren Sicherheiten nach Art und Qualität zum 28. Februar 2023:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	249.766\$

Die nachfolgende Aufgliederung nach Laufzeiten basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitstermin der umgekehrten Pensionsgeschäfte und der zugehörigen erhaltenen/gestellten Sicherheiten zum 28. Februar 2023:

Fonds	Art der Sicherheit	Derivats/der	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)						Gesamt (in Tsd.)	
			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.)
Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund	Umgekehrte Rückkaufvereinbarungen		-	244.848\$	-	-	-	-	-	244.848\$
	Erhaltene unbare Sicherheiten		-	\$ 5	76.515\$	-	3.267\$	169.979\$	-	249.766\$

Bei den umgekehrten Pensionsgeschäften, die für den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, handelt es sich um Dreiparteienverträge. Die vom Fonds erhaltenen Sicherheiten in Bezug auf die offenen umgekehrten Pensionsgeschäfte zum 28. Februar 2023 werden in getrennten Konten bei The Bank of New York Mellon im Namen der Gesellschaft gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Alle Kosten und Renditen aus umgekehrten Rückkaufvereinbarungen laufen in voller Höhe für den Fonds auf.

Anhang: Offenlegung verbundener Personen (ungeprüft)

Während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2023 erbrachte Pershing Limited, eine Tochtergesellschaft von The Bank of New York Mellon Corporation und eine mit der Verwahrstelle verbundene Person, Brokerdienstleistungen im Zusammenhang mit dem Wertpapierhandel für die in Hongkong registrierten Fonds, über die Untereinlageverwalter der jeweiligen Fonds. Der Gesamtwert der Transaktionen mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen im Zusammenhang mit dem Wertpapierhandel belief sich auf 193 Mio. US-Dollar, was 0,11 % des Gesamtwerts dieser von diesen Fonds getätigten Transaktionen entspricht. Die von den Fonds an Pershing Limited im Zusammenhang mit diesem Wertpapierhandel für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2023 gezahlten Brokergebühren und Provisionen beliefen sich auf 141.301 US-Dollar mit einem durchschnittlichen Provisionssatz von 7 Basispunkten. Diese sind in den Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe relevanter Wertpapiere enthalten und in Erläuterung 4 dieses Abschlusses ausgewiesen.

Während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2023 waren The Bank of New York Mellon (Institutional Bank) und The Bank of New York Mellon SA/NV, beides verbundene Personen der Verwahrstelle, bei Devisentransaktionen (Verwahrung) und Währungsverwaltungs-/Absicherungsprogrammen jeweils für die in Hongkong registrierten Fonds tätig. Die im Zusammenhang mit diesen Transaktionen insgesamt gezahlten Provisionen beliefen sich auf 833.647 US-Dollar mit einem durchschnittlichen Provisionssatz von 0,20 Basispunkten. Der Gesamtwert der diesbezüglichen Transaktionen mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen belief sich auf 40.718 Mio. US-Dollar, was 2,08 % des Gesamtwerts dieser von den Fonds getätigten Transaktionen entspricht.

Sämtliche Transaktionen mit den verbundenen Parteien der Verwahrstelle wurden im ordentlichen Geschäftsgang des gewöhnlichen Geschäftsverkehrs und zu marktüblichen Bedingungen geschlossen.

Überarbeiteter Anhang: Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR) (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 klassifizierte Fonds (ein „Artikel 8-Fonds“) seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wird. 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 enthält für jeden Artikel-8-Fonds nach SFDR die regelmäßigen Angaben, die unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS gemacht wurden. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft. Die Klassifikationen der Anlagewerte in den folgenden Angaben basieren auf MSCI und können von der Klassifikation der Wertpapiere in den Anlagenportfolios abweichen.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

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 Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,30% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 3,30 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	121,00	95,90%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	235,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	95,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,95%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,64%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,37%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,67%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,59%	USA
FANNIE MAE POOL	Staatsanleihen	0,57%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,52%	USA
CREDIT SUISSE MORTGAGE CAPITAL CERTIFICATES	Finanzen	0,51%	USA
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	0,50%	Mexiko
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Staatsanleihen	0,49%	USA
BHMS MORTGAGE TRUST	Finanzen	0,49%	USA
HOME EQUITY ASSET TRUST	Finanzen	0,49%	USA
ABBVIE INC	Gesundheitssektor	0,46%	USA
ISRAEL FIXED BOND	Staatsanleihen	0,42%	Israel
LONG BEACH MORTGAGE LOAN TRUST	Finanzen	0,41%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

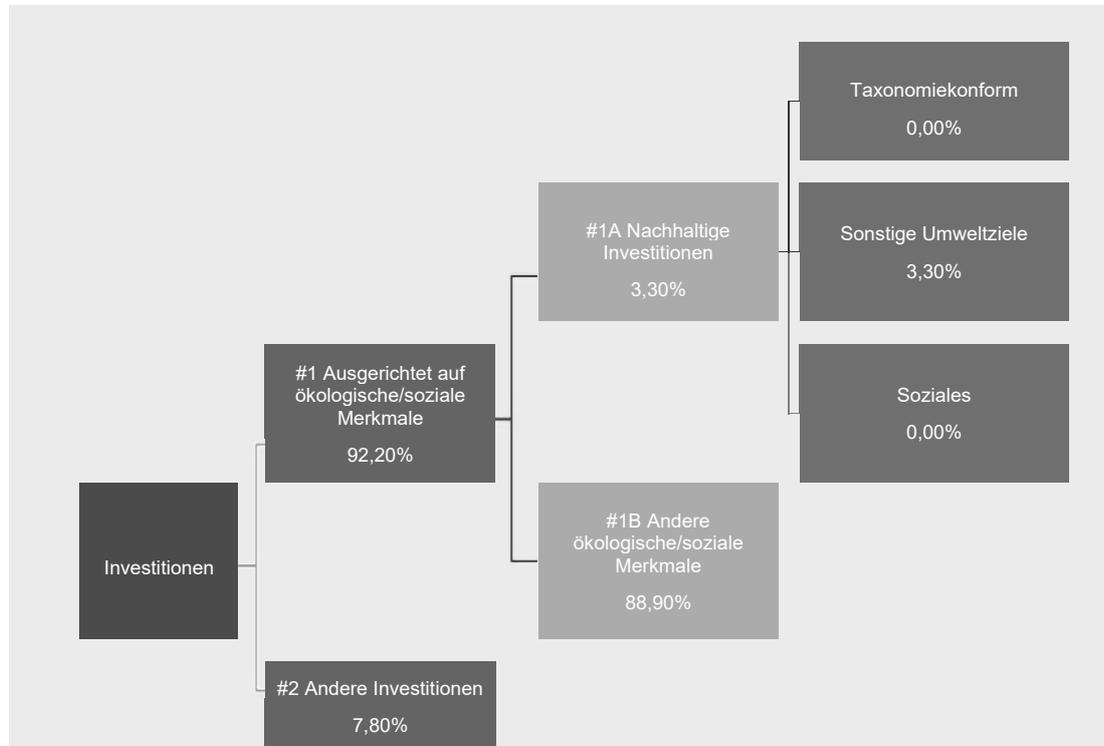
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 3,30 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

92,20 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (7,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 3,30 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Staatsanleihen	40,47%
Finanzen	38,44%
Energie	4,54%
Kommunikationsdienste	3,78%
Gesundheitssektor	2,57%
Informationstechnologie	1,97%
Zyklische Konsumgüter	1,87%
Industrie	1,57%
Grundstoffe	1,35%
Versorgungsunternehmen	0,93%
Nichtzyklische Konsumgüter	0,86%
immobilien	0,40%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Staatsanleihen	40,70%
Finanzdienstleistungen	25,41%
Banken	8,94%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	4,24%
Kapitalmärkte	2,11%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,55%
Medien	1,38%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,30%
Metalle und Bergbau	0,91%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	0,84%
Versicherungen	0,71%
Biotechnologie	0,68%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	0,68%
Software	0,62%
Hypotheken-Immobilienfonds	0,60%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar 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 Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

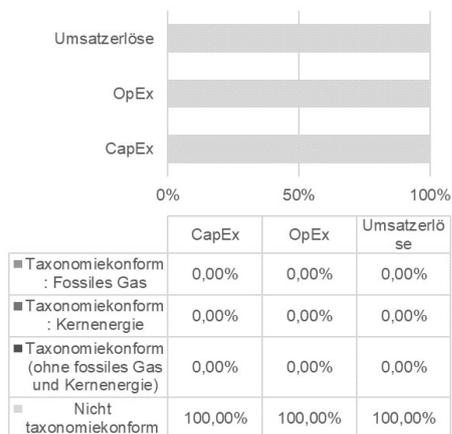
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

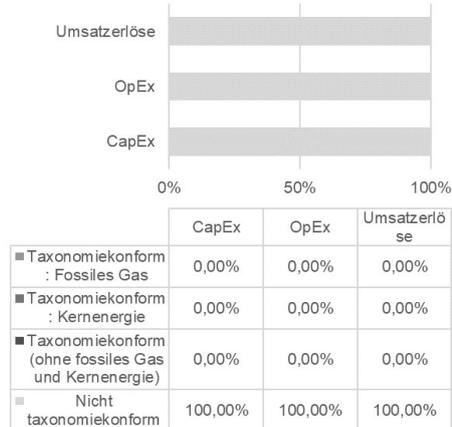
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 3,30 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 7,80 % und umfasste als Einlagen gehaltene 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.

B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Das unterstützte die Ausrichtung des Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität).

C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 3,3 % gemessen am prozentualen Marktwert 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 63,6 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 26,0 % ggü. 17,4 % der Benchmark.

D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 3,3 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

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 US Core Plus Bond Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
472PNIHDHJOEBNUD0P21



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 3,30% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 3,30 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	149,90	93,20%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	232,10	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	92,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	92,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,87%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,55%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,54%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,17%	USA
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	0,85%	Mexiko
REPUBLIK INDONESIA	Staatsanleihen	0,78%	Indonesien
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	0,75%	Mexiko
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,71%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,71%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,69%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,61%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,60%	USA
FIELDSTONE MORTGAGE INVESTMENT CORP	Finanzen	0,57%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,51%	USA
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	0,50%	Mexiko



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

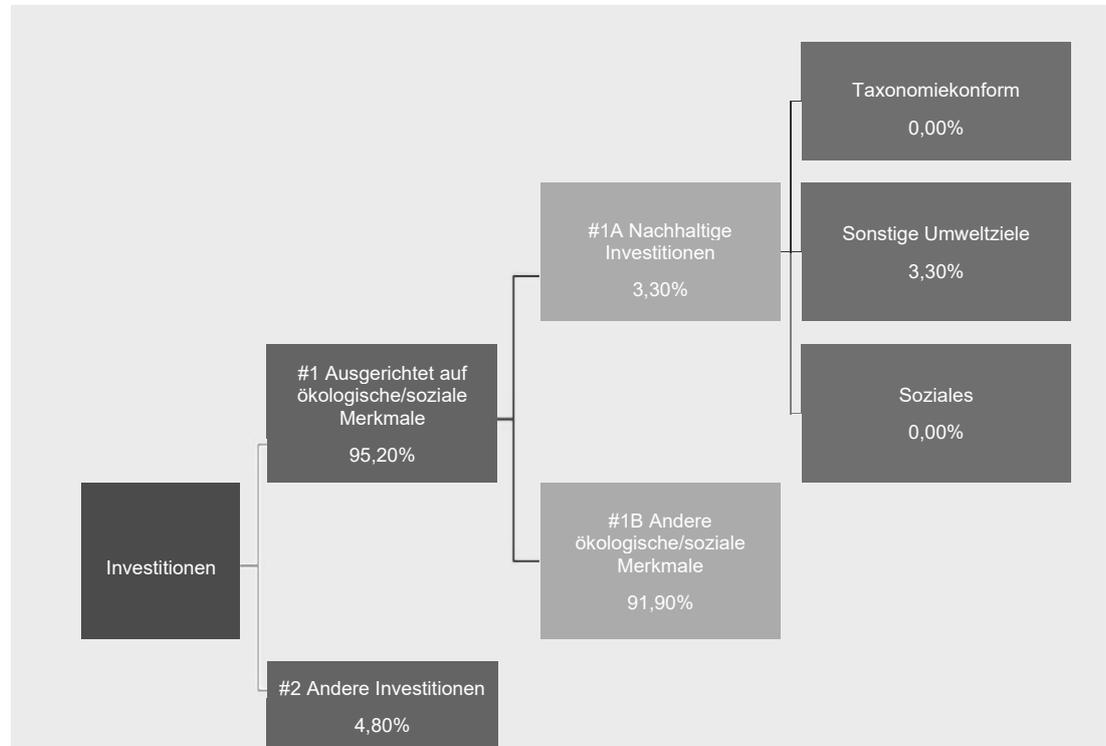
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 3,30 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,20 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (4,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 3,30 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Staatsanleihen	46,13%
Finanzen	27,14%
Kommunikationsdienste	4,45%
Energie	4,37%
Gesundheitssektor	3,79%
Zyklische Konsumgüter	3,27%
Industrie	1,79%
Informationstechnologie	1,71%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,09%
Grundstoffe	0,73%
Versorgungsunternehmen	0,66%
immobilien	0,55%
Privatanlagen	0,00%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Staatsanleihen	46,33%
Finanzdienstleistungen	14,51%
Banken	7,90%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	4,24%
Kapitalmärkte	3,40%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,08%
Medien	1,92%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,61%
Hotels, Restaurants und Freizeit	1,04%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	0,84%
Pharmazie	0,83%
Automobilindustrie	0,83%
Barmitteläquivalente	0,70%
Fluggesellschaften	0,66%
Hypotheken-Immobilienfonds	0,65%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem 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 Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

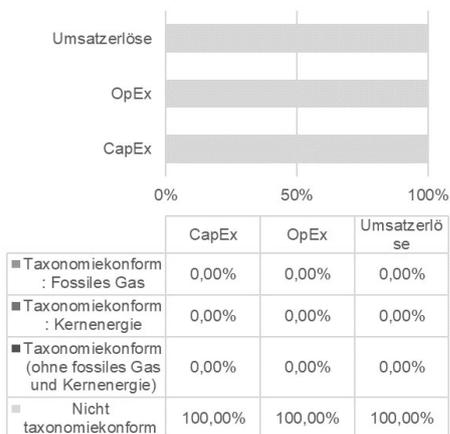
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

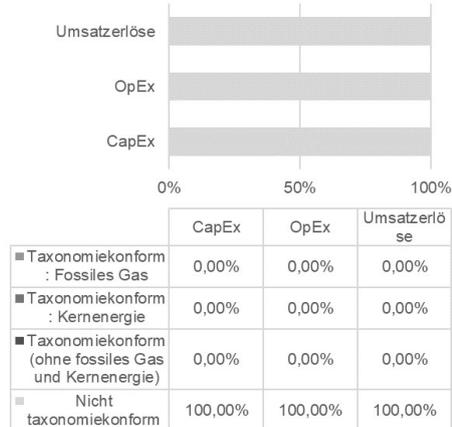
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichte Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 3,30 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 4,80 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset sind für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.

B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihres Umsatzes 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 31. Dezember 2022 3,3 % gemessen am prozentualen Marktwert 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 bei 70,0 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 27,2 % ggü. 17,4 % der Benchmark.

D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 3,3 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

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 Multi Strategy Fund



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493004ZO0T2R3JB1A61

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,20% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 2,20 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	184,30	80,40%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	245,00	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	83,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	83,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	2,67%	Mexiko
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC – WESTERN ASSET EUROPEAN LOAN	Finanzen	2,59%	Irland
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC – WESTERN ASSET INDIA BOND FUND	Finanzen	1,91%	Irland
REPUBLIK INDONESIA	Staatsanleihen	1,64%	Indonesien
REPUBLIK INDONESIA	Staatsanleihen	1,36%	Indonesien
REPUBLIK SÜDAFRIKA	Staatsanleihen	1,22%	Südafrika
REPUBLIK POLEN	Staatsanleihen	1,08%	Polen
T-MOBILE US INC	Kommunikationsdienste	0,99%	USA
FÖDERATIVE REPUBLIK BRASILIEN	Staatsanleihen	0,93%	Brasilien
ALLIANZ SE	Finanzen	0,91%	Deutschland
RANGE RESOURCES CORP	Energie	0,90%	USA
LM-WA EURO HI YIELD-LMA	Finanzen	0,84%	Irland
UBS GROUP AG	Finanzen	0,82%	Schweiz
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,80%	USA
GRUPO MEXICO SAB DE CV	Grundstoffe	0,79%	Mexiko



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

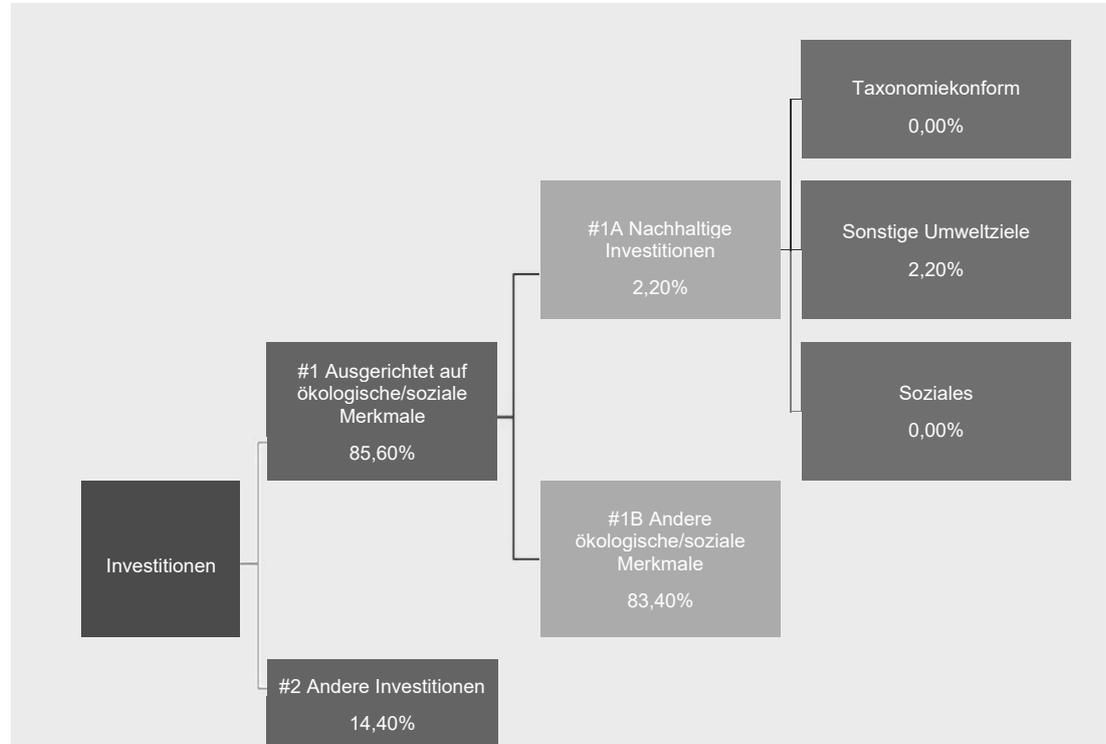
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 2,20 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

85,60 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (14,40 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 2,20 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	26,16%
Staatsanleihen	25,41%
Kommunikationsdienste	8,65%
Zyklische Konsumgüter	6,89%
Energie	5,86%
Grundstoffe	4,98%
Industrie	4,90%
Gesundheitssektor	3,37%
Informationstechnologie	1,56%
immobilien	1,39%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,17%
Versorgungsunternehmen	0,11%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Staatsanleihen	25,32%
Finanzdienstleistungen	12,15%
Banken	8,24%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	4,72%
Medien	4,02%
Hotels, Restaurants und Freizeit	4,01%
Kapitalmärkte	3,67%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,59%
Fluggesellschaften	2,10%
Metalle und Bergbau	1,88%
Pharmazie	1,66%
Versicherungen	1,60%
Container & Verpackungen	1,37%
Automobilindustrie	1,23%
Chemische Erzeugnisse	1,20%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

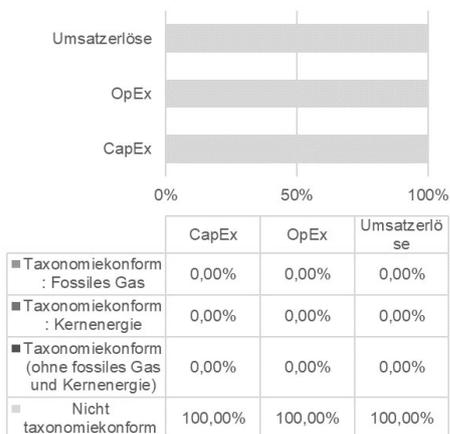
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

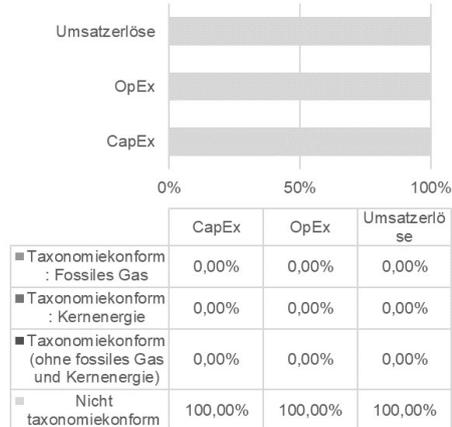
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 2,20 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 14,40 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset sind für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % in Wertpapier 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 31. Dezember 2022 2,2 % gemessen am prozentualen Marktwert 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 BBB.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 69,7 % der Benchmark.
- C. Die Zuordnung des Fonds zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 31,8 %.

D Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493005YY2WWWVLYH2080



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 5,30% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - THG-Intensität (PAI Nr. 10)
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der 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:

- 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 bei 5,30 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC und die OECD-Grundsätze 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 vom Freedom House nicht als frei bezeichnet werden. Aufgrund der umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der 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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	230,20	72,90%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	175,30	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	72,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	73,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	Gesundheitssektor	0,98%	Israel
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	Grundstoffe	0,94%	Kanada
BOHAI LEASING CO LTD	Finanzen	0,88%	Kaimaninseln
DISH NETWORK CORP	Kommunikationsdienste	0,72%	USA
DISH NETWORK CORP	Kommunikationsdienste	0,71%	USA
UNITED RENTALS INC	Industrie	0,70%	USA
FORD MOTOR CO	Zyklische Konsumgüter	0,68%	USA
FREEMPORT-MCMORAN INC	Grundstoffe	0,67%	USA
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	Immobilien	0,65%	USA
ALLEN MEDIA LLC	Kommunikationsdienste	0,63%	USA
CHORD ENERGY CORP	Energie	0,62%	USA
VIKING HOLDINGS LTD	Zyklische Konsumgüter	0,61%	USA
WYNN RESORTS LTD	Zyklische Konsumgüter	0,60%	MACAO
JUNIPER CAPITAL ADVISORS LP	Energie	0,60%	USA
FULL HOUSE RESORTS INC	Zyklische Konsumgüter	0,57%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

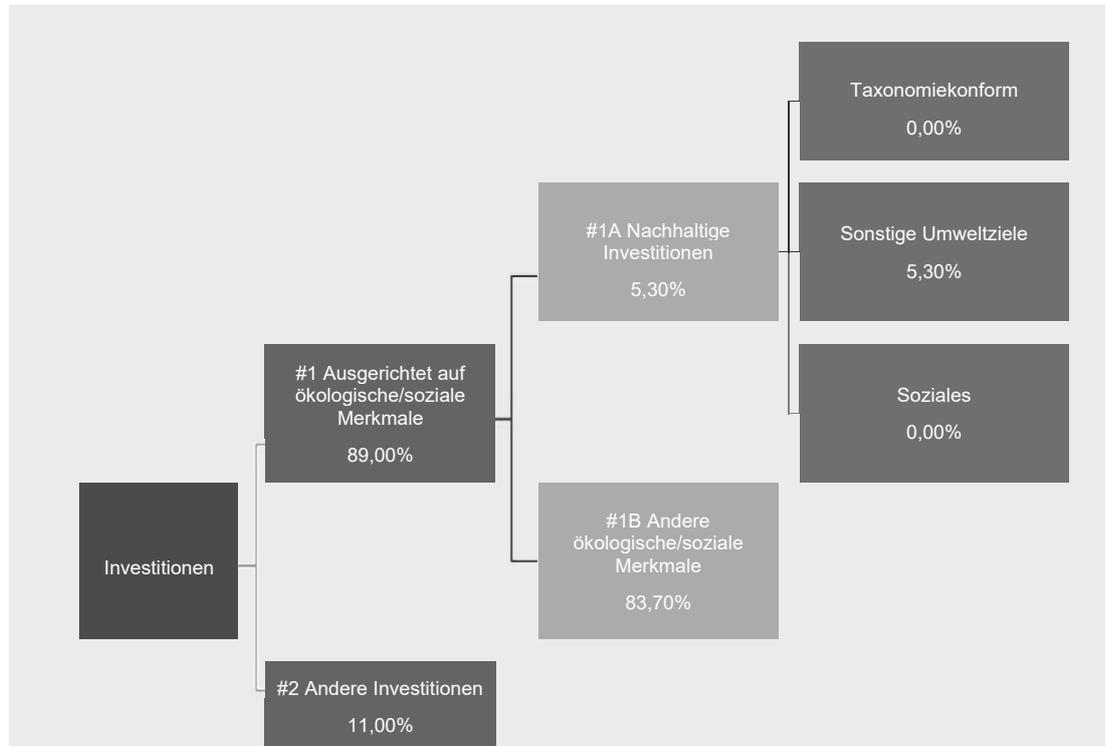
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 5,30 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

89,00 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (11,00 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 5,30 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	22,86%
Zyklische Konsumgüter	19,98%
Industrie	12,09%
Kommunikationsdienste	11,25%
Energie	9,53%
Gesundheitssektor	6,08%
Grundstoffe	5,07%
Informationstechnologie	4,70%
immobilien	3,56%
Versorgungsunternehmen	1,73%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,33%
Staatsanleihen	0,18%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Finanzdienstleistungen	15,97%
Hotels, Restaurants und Freizeit	8,79%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	7,95%
Medien	7,58%
Pharmazie	3,44%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	3,08%
Kapitalmärkte	2,91%
Aktien-Immobilienfonds	2,85%
Metalle und Bergbau	2,79%
Fachhandel	2,78%
Automobilindustrie	2,74%
Maschinen	2,59%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,41%
Fluggesellschaften	2,29%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,26%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem 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 Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

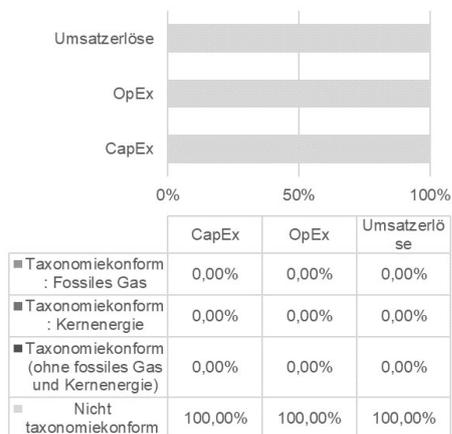
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

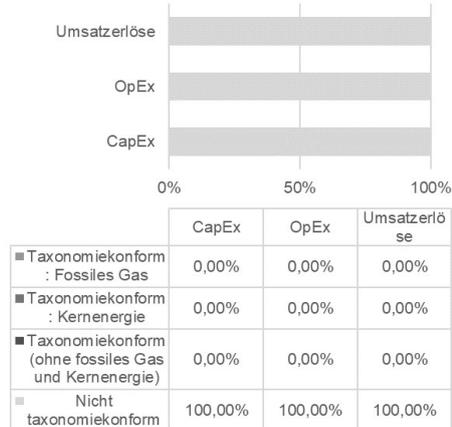
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 5,30 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 11,00 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Weighted Average Carbon Intensity, „WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war zudem bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

e. Bundesstaatliche und/oder staatliche Emittenten, die vom Freedom House Index nicht als „frei“ bezeichnet werden (im Einklang mit PAI-Indikator Nr. 16, Staaten, in die investiert wird, mit sozialen Verstößen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds 5,3 % gemessen am prozentualen Marktwert zum 31. Dezember 2022 investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 82,8 % der Benchmark.

B. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 33,0 % ggü. 31,8 % der Benchmark.

C. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 5,3 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert investiert.

D. Die Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 6,90% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 6,90 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	287,10	83,60%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	221,40	95,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,02%	82,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	83,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	Gesundheitssektor	3,52%	Israel
SAGA PLC	Finanzen	2,24%	Vereinigtes Königreich
CHARTER COMMUNICATIONS INC	Kommunikationsdienste	2,13%	USA
FORD MOTOR CO	Zyklische Konsumgüter	2,09%	USA
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	Industrie	1,65%	USA
REPUBLIK TÜRKEI	Staatsanleihen	1,56%	Türkei
MERCADOLIBRE INC	Zyklische Konsumgüter	1,41%	Brasilien
FORD MOTOR CO	Zyklische Konsumgüter	1,39%	USA
BOHAI LEASING CO LTD	Finanzen	1,28%	Kaimaninseln
J B POINDEXTER & CO	Zyklische Konsumgüter	1,26%	USA
LM-WA EURO HI YIELD-LMA	Finanzen	1,21%	Irland
FRANKLIN TEMPLETON QUALIFIED INVESTOR FUNDS II PLC – WESTERN ASSET EUROPEAN LOAN	Finanzen	1,08%	Irland
H&E EQUIPMENT SERVICES INC	Industrie	1,06%	USA
VODAFONEZIGGO GROUP HOLDING BV	Finanzen	1,04%	Niederlande
DISH NETWORK CORP	Kommunikationsdienste	1,00%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

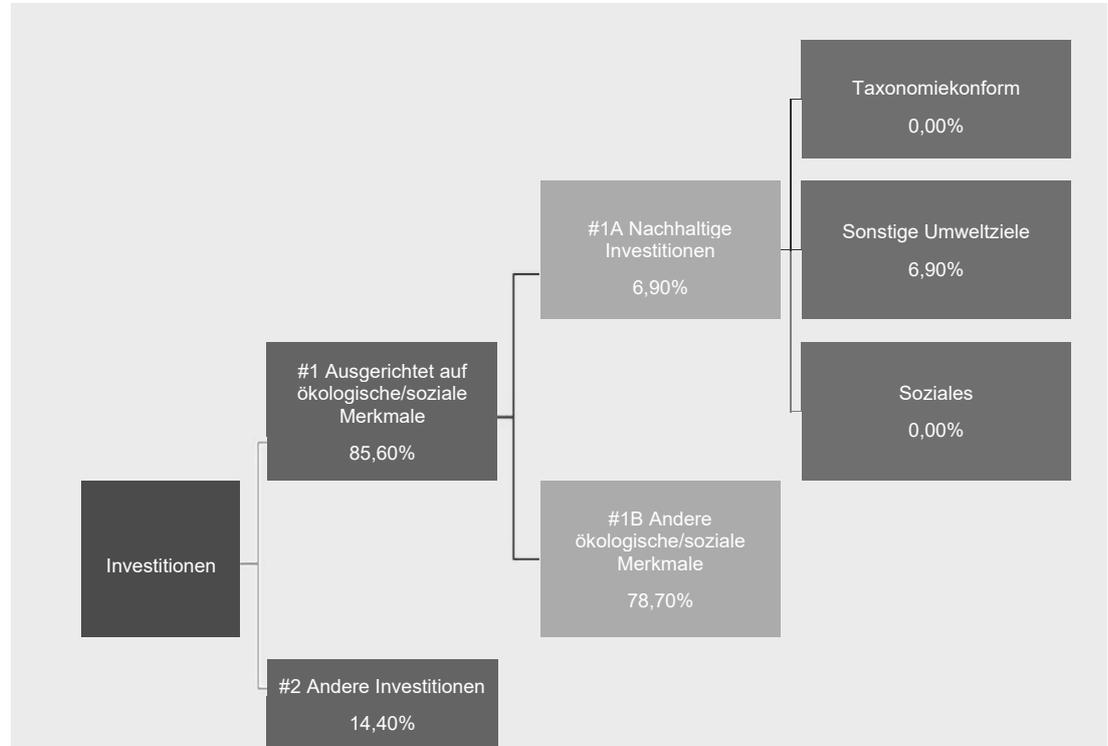
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 6,90 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

85,60 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (14,40 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 6,90 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Zyklische Konsumgüter	21,02%
Staatsanleihen	18,95%
Finanzen	15,51%
Kommunikationsdienste	15,35%
Industrie	6,82%
Gesundheitssektor	4,83%
Grundstoffe	3,85%
Energie	3,68%
immobilien	1,94%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,62%
Versorgungsunternehmen	1,11%
Informationstechnologie	0,55%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Staatsanleihen	18,95%
Hotels, Restaurants und Freizeit	10,96%
Medien	9,45%
Finanzdienstleistungen	7,19%
Automobilindustrie	5,04%
Pharmazie	4,13%
Fluggesellschaften	3,99%
Kapitalmärkte	3,40%
Banken	3,27%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,84%
Container und Verpackungen	2,79%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	2,66%
Diversifizierte Verbraucherdienstleistungen	2,11%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	2,06%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	1,77%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwere aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

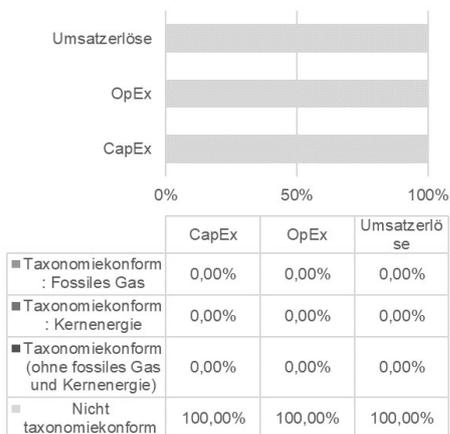
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

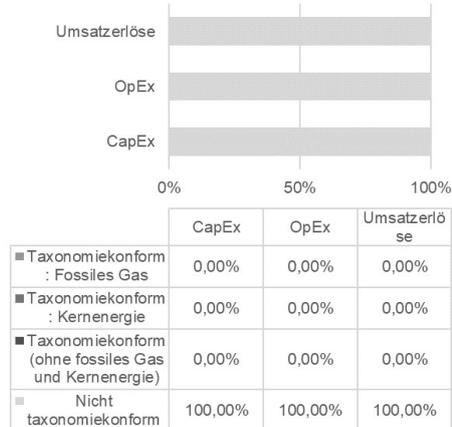
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 6,90 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 14,40 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset sind für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten 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 sollte seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität (Weighted Average Carbon Intensity, „WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war zudem bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 6,9 % gemessen am prozentualen Marktwert investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

A. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 82,8 % der Benchmark.

B. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 31,9 % ggü. 30,5 % der Benchmark.

C. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 6,9 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert investiert.

D. Der Fonds hatte eine Position in einem einzelnen Emittenten, bei dem ein Verstoß gegen die SRI-Leitsätze festgestellt wurde. Das war das Ergebnis eines Übergangs im Status von Artikel 6 zu Artikel 8. Nach dieser Entdeckung wurde der Emittent veräußert.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493000382HJNRHILX42

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 12,30% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - THG-Intensität (PAI Nr. 10)
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der 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:

- 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 bei 12,30 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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 in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zur Benchmark des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die der Anlageverwalter festgelegt hat. 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.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC und die OECD-Grundsätze 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 vom Freedom House nicht als frei bezeichnet werden. Aufgrund der umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der 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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	63,20	94,60%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	247,50	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	95,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	3,34%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,77%	USA
KREDITANSTALT FÜR WIEDERAUFBAU	Staatsanleihen	1,76%	Deutschland
INTER-AMERICAN DEVELOPMENT BANK	Staatsanleihen	1,73%	Supranationale Titel
MERCK & CO INC	Gesundheitssektor	1,60%	USA
ROCHE HOLDING AG	Gesundheitssektor	1,56%	USA
CHARLES SCHWAB CORP	Finanzen	1,54%	USA
CITIGROUP INC	Finanzen	1,52%	USA
EXXON MOBIL CORP	Energie	1,50%	USA
ECOLAB INC	Grundstoffe	1,49%	USA
CREDIT AGRICOLE GROUP	Finanzen	1,48%	Frankreich
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,45%	USA
FORENINGEN NYKREDIT	Finanzen	1,37%	Dänemark
NIKE INC	Zyklische Konsumgüter	1,33%	USA
NATWEST GROUP PLC	Finanzen	1,16%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

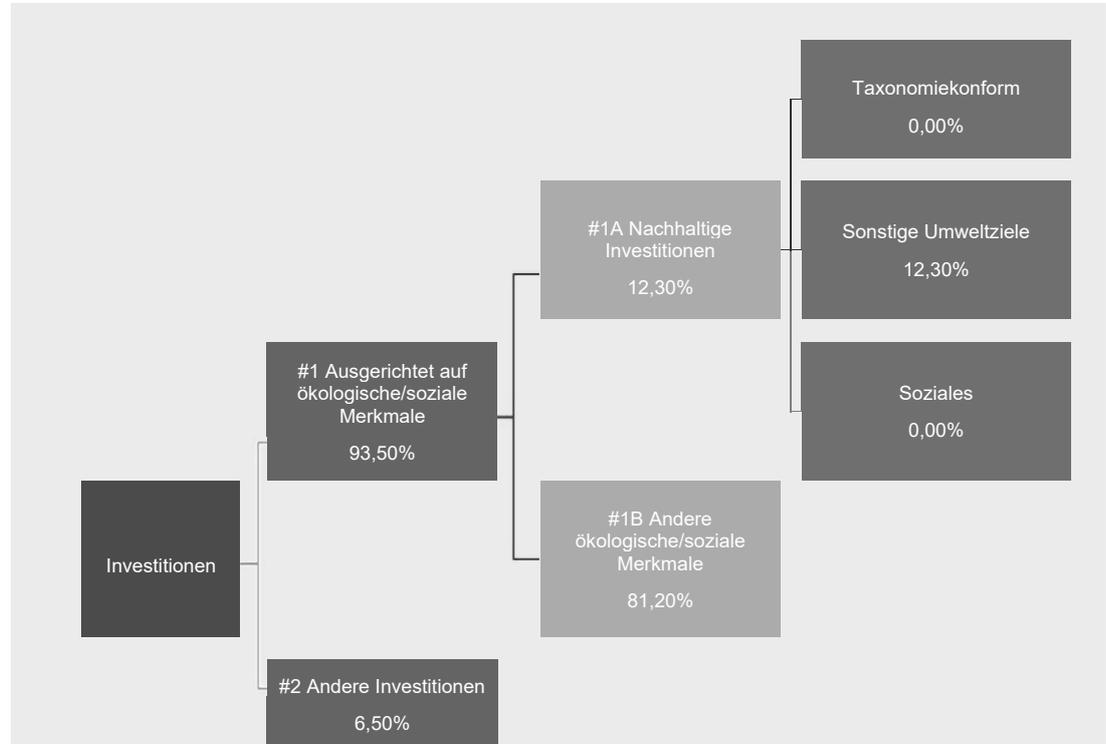
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 12,30 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

93,50 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (6,50 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 12,30 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	39,40%
Staatsanleihen	15,60%
Gesundheitssektor	8,72%
Industrie	6,45%
Nichtzyklische Konsumgüter	5,02%
Informationstechnologie	4,59%
Zyklische Konsumgüter	4,54%
immobilien	3,56%
Energie	3,41%
Kommunikationsdienste	2,22%
Versorgungsunternehmen	2,10%
Grundstoffe	1,65%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	19,36%
Staatsanleihen	14,63%
Finanzdienstleistungen	10,68%
Pharmazie	6,46%
Kapitalmärkte	5,76%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	3,20%
Immobilienverwaltung und -entwicklung	2,22%
Getränke	2,08%
Kundenkreditgeschäft	1,99%
Stromversorger	1,77%
Barmitteläquivalente	1,65%
Chemische Erzeugnisse	1,65%
Industriekonzerne	1,61%
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter	1,46%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	1,37%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

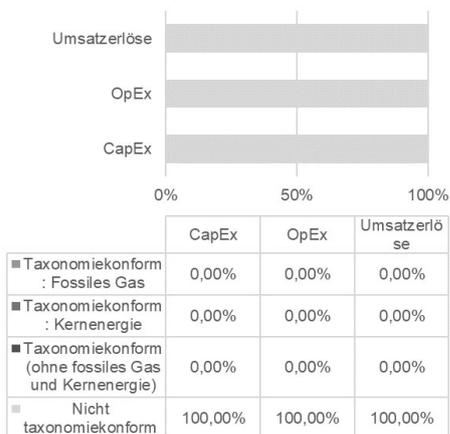
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

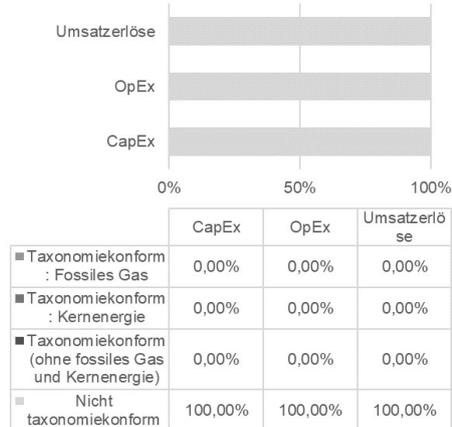
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 12,00 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 6,50 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards. Dies schloss auch Emittenten ein, 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % in Wertpapier 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, mit sozialen Verstößen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 12,3 % gemessen am prozentualen Marktwert investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von AA.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 47,1 % der Benchmark.
- C. Die Zuordnung des Fonds zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 61,5 %.
- D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 12,3 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

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



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930030VHR7UP4BBZ30

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1,60% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 1,60 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds war die Reduzierung der THG-Emissionen, gemessen anhand der gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität. Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt, wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	67,50	88,80%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	231,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	87,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	87,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	9,18%	USA
JAPAN	Staatsanleihen	3,26%	Japan
VEREINIGTES KÖNIGREICH VON GROSSBRITANNIEN UND NORDIRLAND	Staatsanleihen	2,94%	Vereinigtes Königreich
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	2,56%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	2,39%	USA
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	2,21%	USA
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	2,20%	Mexiko
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,76%	USA
JAPAN	Staatsanleihen	1,72%	Japan
REPUBLIK SÜDAFRIKA	Staatsanleihen	1,66%	Südafrika
JAPAN	Staatsanleihen	1,38%	Japan
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,30%	USA
REPUBLIK ITALIEN	Staatsanleihen	1,26%	Italien
AUSTRALISCHE STAATSANLEIHE	Staatsanleihen	1,23%	Australien
KÖNIGREICH SPANIEN	Staatsanleihen	1,15%	Spanien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

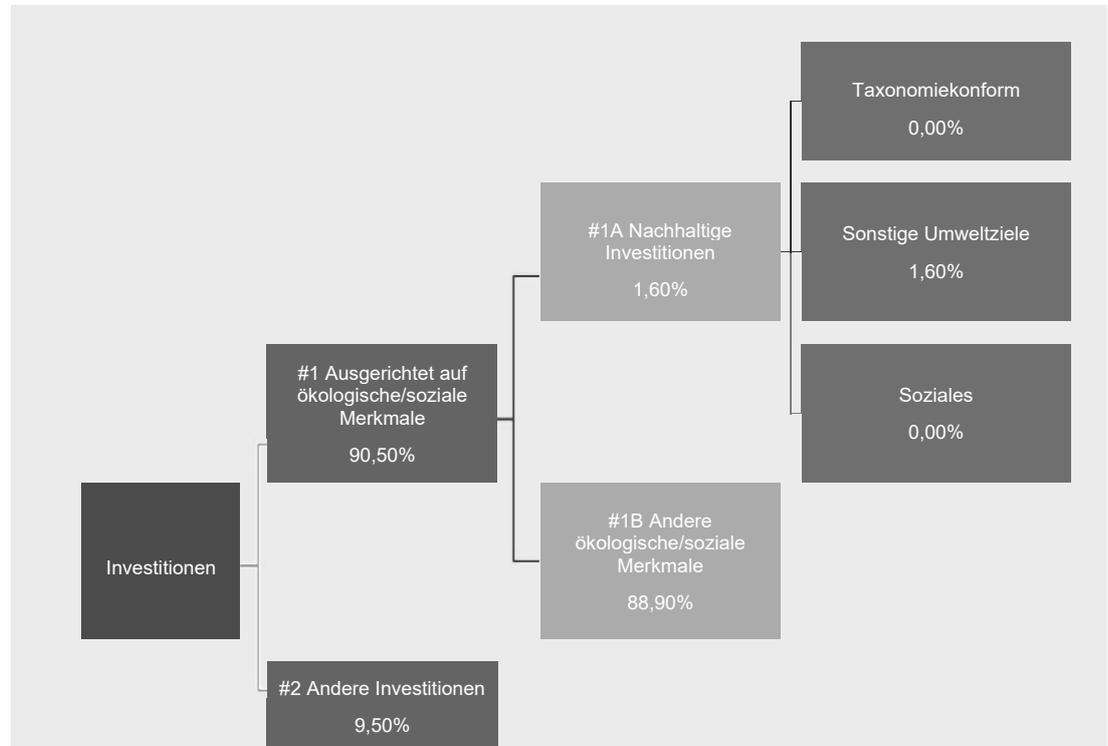
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 1,60 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

90,45 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (9,55 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 1,60 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Staatsanleihen	63,15%
Finanzen	20,94%
Kommunikationsdienste	3,43%
Gesundheitssektor	3,02%
Zyklische Konsumgüter	2,15%
Energie	1,21%
Industrie	0,96%
Grundstoffe	0,84%
immobilien	0,54%
Nichtzyklische Konsumgüter	0,29%
Informationstechnologie	0,19%
Versorgungsunternehmen	0,03%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Staatsanleihen	63,33%
Banken	8,95%
Finanzdienstleistungen	8,06%
Kapitalmärkte	2,57%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,94%
Medien	1,60%
Barmitteläquivalente	1,47%
Automobilindustrie	1,38%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	1,21%
Versicherungen	1,15%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	0,73%
Unterhaltung	0,69%
Metalle und Bergbau	0,56%
Pharmazie	0,53%
Biotechnologie	0,51%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem 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 Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

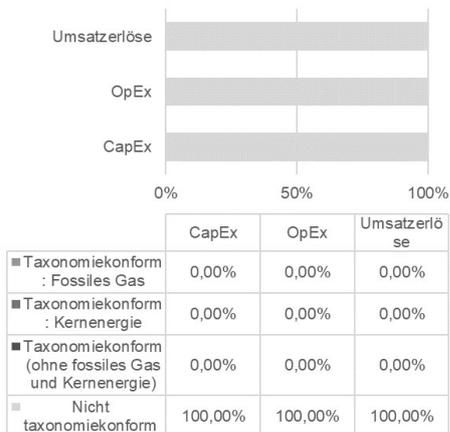
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

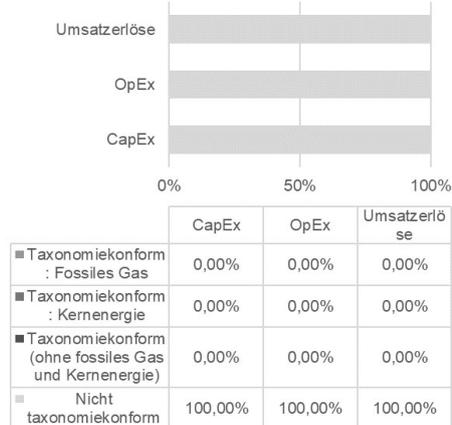
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 1,60 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 9,55 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. 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 strebt insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapieren von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen 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 31. Dezember 2022 1,6 % gemessen am prozentualen Marktwert 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 bei 79,5 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 21,1 % ggü. 14,6 % der Benchmark.

D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 1,6 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

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 UK Investment Grade Credit Fund



FRANKLIN
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300XEUFPR86JA985

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 8,80% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds 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-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

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:

- 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 bei 8,80 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC und die OECD-Grundsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum. Außer den PAI-Komponenten umfasste das PAI-Tool die Bewertung von Ländern, in denen investiert wurde, die infolge der eigenen Bewertung der Anlageverwaltung und den Daten von Drittanbietern als auszuschließen galten. Aufgrund der

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	67,60	95,50%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	159,20	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	95,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
VEREINIGTES KÖNIGREICH VON GROSSBRITANNIEN UND NORDIRLAND	Staatsanleihen	2,01%	Vereinigtes Königreich
EUROPEAN INVESTMENT BANK	Staatsanleihen	1,85%	Supranationale Titel
KREDITANSTALT FÜR WIEDERAUFBAU	Staatsanleihen	1,77%	Deutschland
EUROPEAN INVESTMENT BANK	Staatsanleihen	1,32%	Supranationale Titel
WELLS FARGO & CO	Finanzen	1,27%	USA
UBS GROUP AG	Finanzen	1,21%	Schweiz
BANCO SANTANDER SA	Finanzen	1,12%	Spanien
BRITISH LAND COMPANY PLC	Immobilien	1,05%	Vereinigtes Königreich
CITIGROUP INC	Finanzen	1,04%	USA
LEEDS BUILDING SOCIETY	Finanzen	1,03%	Vereinigtes Königreich
E.ON SE	Industrie	0,95%	Deutschland
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzen	0,93%	Vereinigtes Königreich
DERWENT LONDON PLC	Immobilien	0,90%	Vereinigtes Königreich
COOPERATIEVE RABOBANK UA	Finanzen	0,87%	Niederlande
VERIZON COMMUNICATIONS INC	Kommunikationsdienste	0,83%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

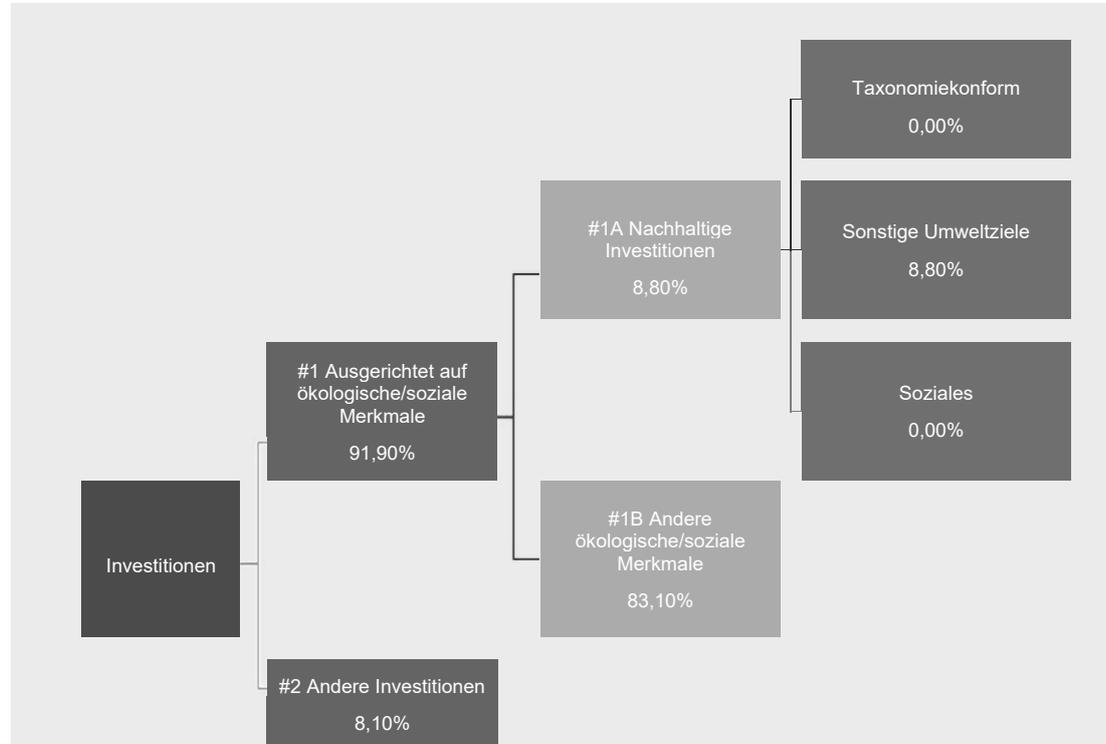
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 8,80 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

91,90 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale des Fonds ausgerichtet. Der verbleibende Teil (8,10 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 8,80 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	46,01%
immobilien	11,39%
Staatsanleihen	9,37%
Versorgungsunternehmen	7,52%
Kommunikationsdienste	6,90%
Industrie	4,64%
Zyklische Konsumgüter	3,96%
Nichtzyklische Konsumgüter	2,71%
Gesundheitssektor	2,17%
Energie	1,86%
Grundstoffe	0,33%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	28,02%
Staatsanleihen	9,61%
Immobilienverwaltung und -entwicklung	6,71%
Finanzdienstleistungen	6,35%
Kapitalmärkte	6,05%
Aktien-Immobilienfonds	4,68%
Stromversorger	4,64%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	4,60%
Versicherungen	3,22%
Automobilindustrie	2,07%
Wasserversorger	1,48%
Barmitteläquivalente	1,48%
Hotels, Restaurants und Freizeit	1,41%
Hypotheken-Immobilienfonds	1,40%
Medien	1,35%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

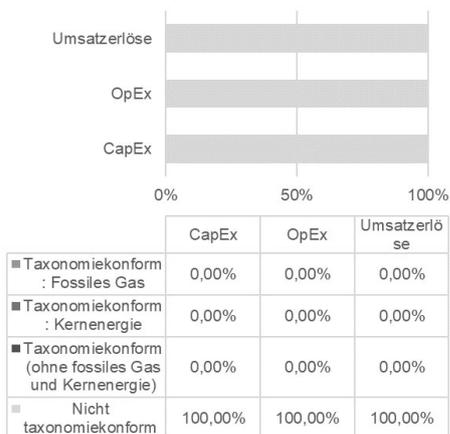
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

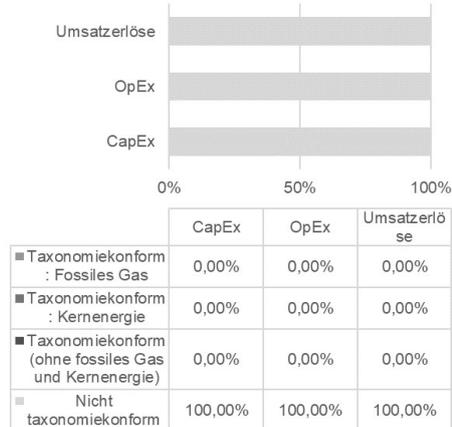
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 8,80 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 8,10 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards oder Emittenten ohne ESG-Rating.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.

B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat.

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 schließt Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstoßen, wie unten ausgeführt:

- Emittenten, die nicht den Prinzipien guter Unternehmensführung folgten, wie von Western Asset festgestellt.
- Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder ihrem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
- Emittenten, die mehr als 10 % ihres Umsatzes aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), der Verbindung zu konventionellen Waffen oder der Gewinnung von Thermalkohle (Produktion/Vertrieb) erzielen.

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 8,8 % gemessen am prozentualen Marktwert investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von AA.

B. Der WACI des Fonds lag bei 73,2 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 63,7 % ggü. 50,9 % der Benchmark.

D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 8,8 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 6,90% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - THG-Intensität (PAI Nr. 10)
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der 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:

- 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 bei 6,90 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht im Vergleich zum Referenzindex des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die vom Anlageverwalter festgelegt wurden. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- Soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC und die OECD-Grundsätze 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 vom Freedom House nicht als frei bezeichnet werden. Aufgrund der umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der 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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	166,90	97,80%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	214,20	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	96,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	97,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
MORGAN STANLEY	Finanzen	0,99%	USA
DANSKE BANK AS	Finanzen	0,88%	Dänemark
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	Finanzen	0,76%	USA
INTESA SANPAOLO SpA	Finanzen	0,62%	Italien
CREDIT SUISSE GROUP AG	Finanzen	0,62%	Schweiz
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	0,59%	USA
VEREINIGTE MEXIKANISCHE STAATEN	Staatsanleihen	0,58%	Mexiko
ENERGY TRANSFER LP	Energie	0,57%	USA
NISSAN MOTOR CO LTD	Zyklische Konsumgüter	0,55%	Japan
CITIGROUP INC	Finanzen	0,53%	USA
WARNER BROS DISCOVERY INC	Kommunikationsdienste	0,53%	USA
BOEING CO	Industrie	0,51%	USA
LAS VEGAS SANDS CORP	Zyklische Konsumgüter	0,50%	USA
BOEING CO	Industrie	0,47%	USA
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE	Finanzen	0,46%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

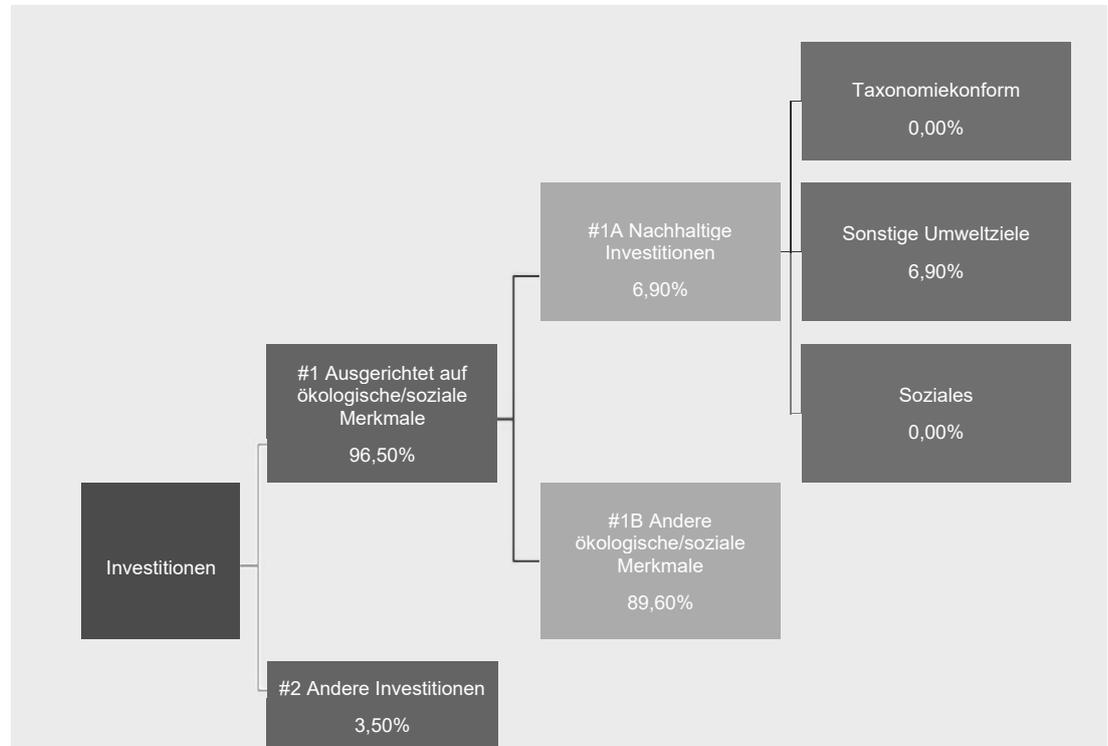
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 6,90 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,50 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,50 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 6,90 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	40,83%
Energie	9,73%
Kommunikationsdienste	6,99%
Industrie	6,78%
Zyklische Konsumgüter	6,60%
Gesundheitssektor	6,17%
Informationstechnologie	4,99%
Staatsanleihen	4,62%
Versorgungsunternehmen	4,18%
Grundstoffe	2,43%
immobilien	1,75%
Nichtzyklische Konsumgüter	1,35%
Kommunalanleihen	0,76%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	22,27%
Kapitalmärkte	9,52%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	9,18%
Finanzdienstleistungen	6,01%
Staatsanleihen	4,76%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,95%
Fluggesellschaften	3,33%
Stromversorger	3,17%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,93%
Hotels, Restaurants und Freizeit	2,30%
Metalle und Bergbau	2,27%
Medien	2,27%
Automobilindustrie	2,10%
Versicherungen	1,90%
Biotechnologie	1,41%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

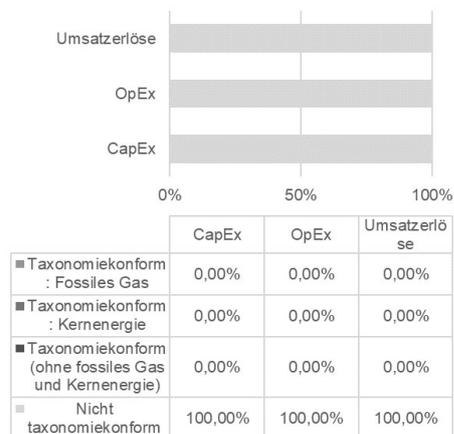
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

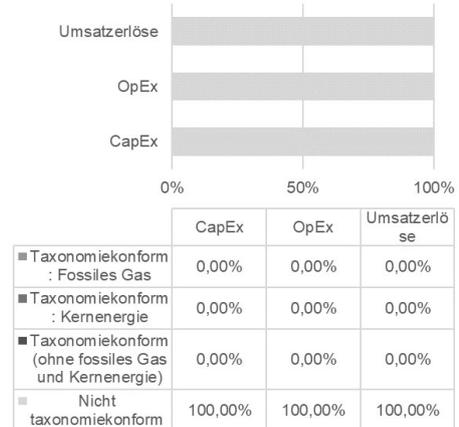
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichte Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 6,90 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 3,50 % 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset sind für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten 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 ist bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.

B. Der Fonds strebt insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.

C. Der Fonds ist bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapieren von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.

D. Der Fonds schließt 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, Staaten, in die investiert wird, mit sozialen Verstößen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 6,9 % gemessen am prozentualen Marktwert 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 bei 69,1 % der Benchmark.

C. Die Zuordnung zu Emittenten und Emissionen, die mit den SDG in Einklang stehen, lag bei 59,8 % ggü. 61,8 % der Benchmark.

D. Der Fonds hatte zum 31. Dezember 2022 6,9 % in nachhaltige Anlagen gemessen am prozentualen Marktwert 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?

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 Sustainable Global Corporate Bond Fund



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900H2PG4695EB6Y14

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 8,38% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) im Vergleich zum Referenzindex des Fonds durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Intensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - THG-Intensität (PAI Nr. 10)
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14), und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der 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:

- 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 bei 8,38 %.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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 in auf die SDG ausgerichteten Emittenten erreicht, im Vergleich zur Benchmark des Fonds und Emittenten, die Best-in-Class-Schwellenwerte erreichten, die der Anlageverwalter festgelegt hat. 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.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 verursachen.

Das PAI-Tool der Anlageverwaltung nutzte Daten vieler verschiedener Quellen (externe Drittanbieter wie unter anderem MSCI ESG, ISS, Weltbank, BloombergNEF, S&P Trucost, Transition Pathway Initiative, Nichtregierungsorganisationen und wissenschaftliche Institutionen), die zusammen mit ihrem eigenen Research die Identifizierung von Emittenten mit im Vergleich zu den PAI-Indikatoren schwachen Nachhaltigkeitsattributen/nachteiligen Auswirkungen unterstützen. 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 obligatorischen PAI einbeziehen konnte und die Messung der Übereinstimmung des Fondsportfolios mit den PAI-Indikatoren unterstützte, die für den Fonds als wesentlich betrachtet wurden. Das PAI-Tool ermittelte Emittenten, die in Bezug auf ihre PAI schlechter abschnitten als die jeweilige Peer-Gruppe, und ermöglichte der Anlageverwaltung eine Bewertung, wie stark der Fonds PAI-Indikatoren im Vergleich zum Referenzindex ausgesetzt ist.

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Intensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Intensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC und die OECD-Grundsätze 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 vom Freedom House nicht als frei bezeichnet werden. Aufgrund der umfassenden Natur der berücksichtigten Datenpunkte half das PAI-Tool bei der Ermittlung der in Bezug auf Emittenten ergriffenen Maßnahmen, darunter unter anderem Engagements und Veräußerungen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Der 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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität (USD)	136,80	98,10%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	192,50	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,00%
Verbindung zu umstrittenen Waffen	0,00%	98,00%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	100,00%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
UBS GROUP AG	Finanzen	2,32%	Schweiz
DANSKE BANK AS	Finanzen	2,25%	Dänemark
ANGLO AMERICAN PLC	Grundstoffe	2,20%	Südafrika
HSBC HOLDINGS PLC	Finanzen	2,19%	Vereinigtes Königreich
BNP PARIBAS SA	Finanzen	2,18%	Frankreich
COOPERATIEVE RABOBANK UA	Finanzen	2,01%	Niederlande
STANDARD CHARTERED PLC	Finanzen	1,98%	Vereinigtes Königreich
GOODMAN EUROPEAN LOGISTICS FUND	Immobilien	1,91%	Frankreich
CREDIT SUISSE GROUP AG	Finanzen	1,80%	Schweiz
INTESA SANPAOLO SPA	Finanzen	1,70%	Italien
ALLIANZ SE	Finanzen	1,68%	Deutschland
ENEL SPA	Versorgungsunternehmen	1,65%	Italien
VEREINIGTE STAATEN VON AMERIKA	Staatsanleihen	1,51%	USA
VERIZON COMMUNICATIONS INC	Kommunikationsdienste	1,49%	USA
VOLKSWAGEN AG	Zyklische Konsumgüter	1,37%	Deutschland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

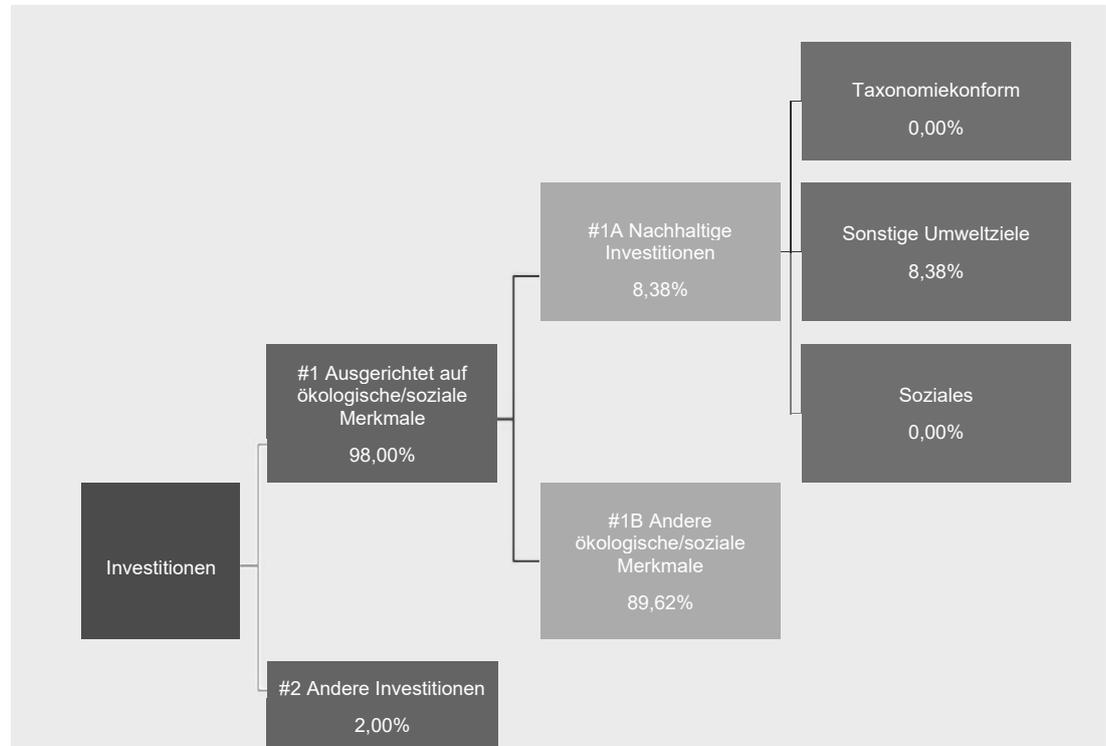
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 8,38 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,00 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,00 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, hielt der Fonds den Mindestwert von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen ein.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	41,32%
Staatsanleihen	11,23%
Versorgungsunternehmen	9,02%
Gesundheitssektor	7,69%
immobilien	6,64%
Kommunikationsdienste	6,49%
Energie	3,99%
Informationstechnologie	2,91%
Nichtzyklische Konsumgüter	2,68%
Zyklische Konsumgüter	2,49%
Grundstoffe	2,16%
Industrie	0,97%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	24,83%
Staatsanleihen	10,73%
Stromversorger	7,14%
Kapitalmärkte	6,55%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	5,11%
Versicherungen	5,11%
Finanzdienstleistungen	4,83%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	4,72%
Öl, Gas u. nicht erneuerbare Brennstoffe	3,99%
Aktien-Immobilienfonds	3,77%
Immobilienverwaltung und -entwicklung	2,87%
Metalle und Bergbau	2,16%
Biotechnologie	1,82%
Barmitteläquivalente	1,63%
Automobilindustrie	1,37%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwere aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

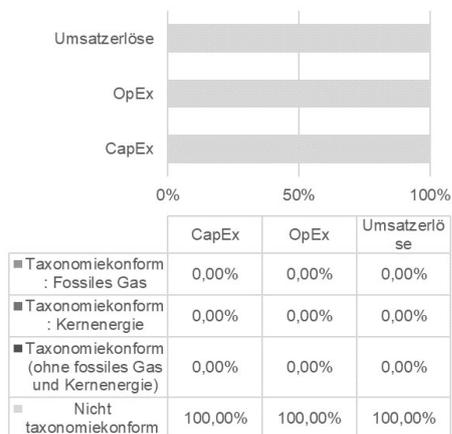
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

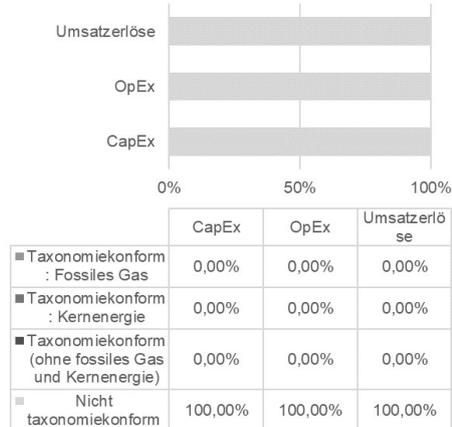
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich die Verpflichtung des Fonds zu einem bestimmten Minimum an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2(17) der SFDR zu tätigen, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann, enthielt der Fonds 8,38 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden kann.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Nicht zutreffend.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,00 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards. Dies schloss auch Emittenten ein, 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 Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben kann. 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. Der Fonds hatte ein Rating von AA.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) an, die mindestens 20 % unterhalb der Benchmark zu liegen hat. Die WACI des Fonds lag bei insgesamt 62,9 % der Benchmark. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Intensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitrugen. Die Zuordnung des Fonds auf Emittenten und Emissionen, die auf SDG ausgerichtet waren, lag bei 68,2 % ggü. 68,4 % der Benchmark.
- 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), und
 - 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 denen investiert wird, mit sozialen Verstößen)).

Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die oben aufgeführten Leitlinien verstießen.

F. Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 31. Dezember 2022 8,4 % gemessen am prozentualen Marktwert investiert.



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 Fixed Income Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300TFZOEP7EEQG432



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Nicht jedes unten angegebene ökologische und/oder soziale Merkmal war zu jedem Zeitpunkt in jeder Investition oder im Fonds enthalten.

Die beworbenen ökologischen Merkmale waren:

- Luftqualität
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Ozeane)
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Land)
- Anpassungsfähigkeit an den Klimawandel
- Exponiertheit gegenüber dem Klimawandel
- Sensibilität gegenüber dem Klimawandel
- Anfälligkeit gegenüber dem Klimawandel
- CO₂-Emissionen aus Energienutzung
- CO₂-Emissionen aus Veränderungen der Landnutzung und Forstwirtschaft
- CO₂-Politik – staatlich
- Abhängigkeit vom Export fossiler Brennstoffe
- Abholzung
- Dürreerisiko
- Energiesicherheit
- Umweltstress
- Treibhausgas (THG)-Emissionen insgesamt
- Verringerung THG-Emissionen: Fortschritt gegenüber Zielsetzung
- Volkswirtschaft mit geringem CO₂-Ausstoß
- Ressourcensicherheit
- Abfallmanagement
- Wasserverschmutzung

- Wassersicherheit

Die beworbenen sozialen Merkmale waren:

- Zugang zu Risikoabhilfe
- Kinderarbeit
- Zivile Unruhen
- Diskriminierung am Arbeitsplatz
- Angemessene Löhne und Gehälter
- Bildung
- Versammlungsfreiheit und Tarifautonomie
- Ernährungssicherheit
- Medizinische Versorgung
- Humankapital
- Rechte indigener Völker
- Schwarzarbeit
- Ausländische Beschäftigte
- Minderheitenrechte
- Moderne Sklaverei
- Gesundheitsschutz und Sicherheit am Arbeitsplatz
- Armut
- Sexuelle Minderheiten
- Entwicklung der Bevölkerung im erwerbsfähigen Alter
- Rechte von Frauen und Mädchen
- Junge Arbeitskräfte

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

A. Spezifische Eingaben in die von der Anlageverwaltung eingesetzte ESG-Scoring-Methode, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Diese Informationen haben folgenden Ursprung:

1. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Malaysia.

B. Nachverfolgung der verpflichtenden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren). Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

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 bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAIs für Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienen. Die Anlageverwaltung beurteilt bei Anlageentscheidungen Schwellenwerte für das Prinzip „keine erheblichen Beeinträchtigungen“ auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Die zwei PAIs für Staaten (PAI 15 (THG-Emissionsintensität) und PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen) waren Bestandteil der eigenen ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	488,87	86,14%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	86,14%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
US TREASURY N/B 1.875% 11/15/51	Staatsanleihen	10,62%	USA
KOREA TRSY BD 2.75% 12/10/44	Staatsanleihen	4,95%	Südkorea
UK TSY GILT 0.25% 07/31/31	Staatsanleihen	4,87%	Vereinigtes Königreich
COLOMBIA TES 6% 04/28/28	Staatsanleihen	4,35%	Kolumbien
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/25	Staatsanleihen	3,96%	Brasilien
FRANCE O.A.T. 0% 05/25/32	Staatsanleihen	3,83%	Frankreich
MEXICAN BONOS 7.75% 11/13/42	Staatsanleihen	3,57%	Mexiko
MEXICAN BONOS 8.5% 11/18/38	Staatsanleihen	3,10%	Mexiko
MEXICAN BONOS 8.5% 05/31/29	Staatsanleihen	2,80%	Mexiko
INT BK RECON&DEV 4.25% 01/22/26	Staatsanleihen	2,77%	Supranationale Titel
MEXICAN BONOS 8% 11/07/47	Staatsanleihen	2,22%	Mexiko
INT BK RECON&DEV 7.25% 01/21/27	Staatsanleihen	2,15%	Supranationale Titel
REP SOUTH AFRICA 8.75% 02/28/48	Staatsanleihen	2,11%	Südafrika
US TREASURY N/B 2.25% 02/15/52	Staatsanleihen	2,10%	USA
REP SOUTH AFRICA 6.5% 02/28/41	Staatsanleihen	2,08%	Südafrika



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

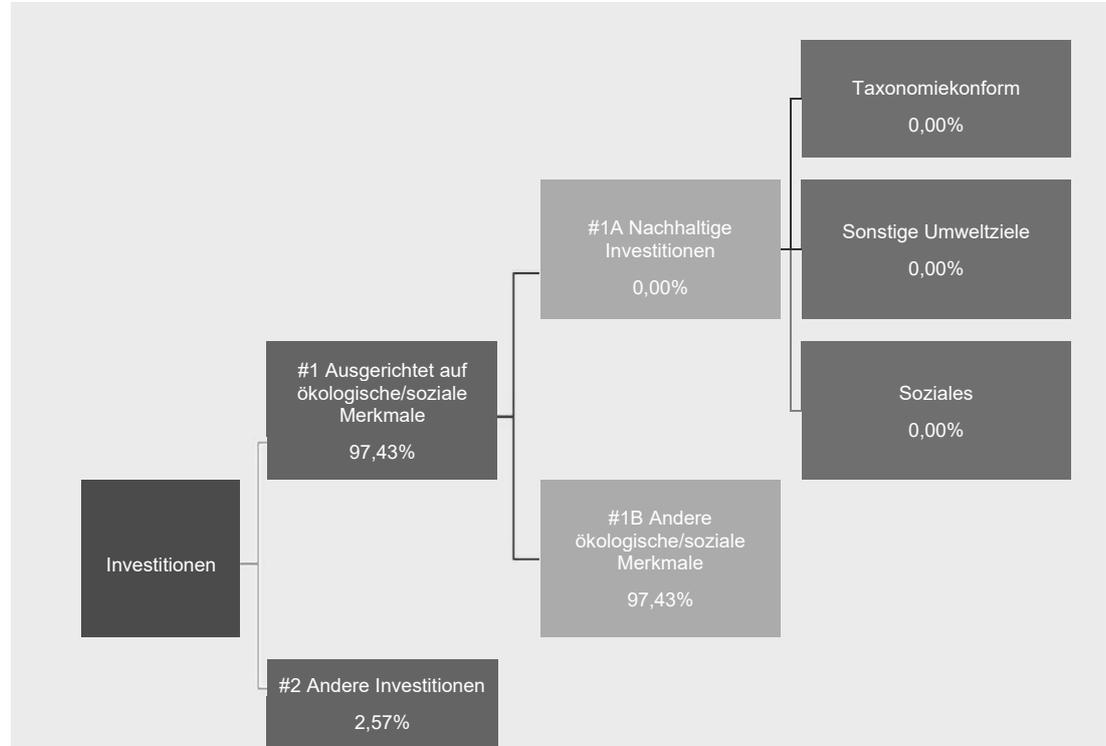
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,43 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,57 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Der Fonds hat keine nachhaltigen Investitionen getätigt.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Staatsanleihen	96,35%
Derivate	0,89%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
STAATLICH	84,56%
SUPRANATIONALE BANK	9,14%
REGIONALE BEHÖRDEN	2,65%
DERVIS	0,89%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

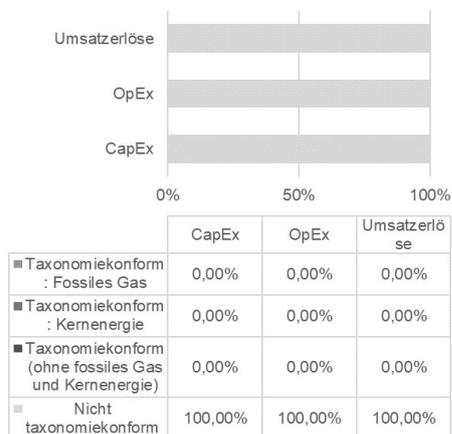
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

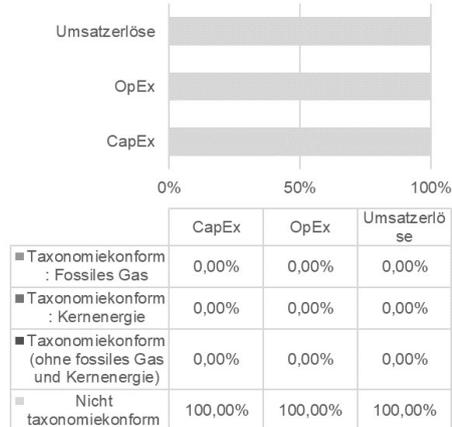
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend.

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

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 „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,57 % 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. 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: Malaysia
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

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300373IZ316KVU890



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 1,18% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die Fondsstrategie orientierte sich nicht an einem Referenzindex. Daher spiegelten die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale mehrere Rentensektoren wider und wurden nach Ländern, Fundamentaldaten und Sektoren angegeben. Nicht jedes unten angegebene ökologische und/oder soziale Merkmal war zu jedem Zeitpunkt in jeder Investition oder im Fonds enthalten.

Die ökologischen Merkmale von Staaten, die der Fonds für seine Anlagen in Staatsanleihen bewirbt, waren:

- Luftqualität
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Ozeane)
- Artenvielfalt und Schutzgebiete (Land)
- Anpassungsfähigkeit an den Klimawandel
- Exponiertheit gegenüber dem Klimawandel
- Sensibilität gegenüber dem Klimawandel
- Anfälligkeit gegenüber dem Klimawandel
- CO₂-Emissionen aus Energienutzung
- CO₂-Emissionen aus Veränderungen der Landnutzung und Forstwirtschaft
- CO₂-Politik – staatlich
- Abhängigkeit vom Export fossiler Brennstoffe
- Abholzung
- Dürreerisiko
- Energiesicherheit
- Umweltstress
- THG-Emissionen insgesamt
- Verringerung THG-Emissionen: Fortschritt gegenüber Zielsetzung
- Volkswirtschaft mit geringem CO₂-Ausstoß
- Ressourcensicherheit

- Abfallmanagement
- Wasserverschmutzung
- Wassersicherheit

In Bezug auf seine Investitionen in Staatsanleihen bewarb der Fonds die folgenden sozialen Merkmale:

- Zugang zu Risikoabhilfe
- Kinderarbeit
- Zivile Unruhen
- Diskriminierung am Arbeitsplatz
- Angemessene Löhne und Gehälter
- Bildung
- Versammlungsfreiheit und Tarifautonomie
- Ernährungssicherheit
- Medizinische Versorgung
- Humankapital
- Rechte indigener Völker
- Schwarzarbeit
- Ausländische Beschäftigte
- Minderheitenrechte
- Moderne Sklaverei
- Gesundheitsschutz und Sicherheit am Arbeitsplatz
- Armut
- Sexuelle Minderheiten
- Entwicklung der Bevölkerung im erwerbsfähigen Alter
- Rechte von Frauen und Mädchen
- Junge Arbeitskräfte

Die unternehmerischen, ökologischen und sozialen Merkmale, die der Fonds bei seinen Anlagen in Unternehmensanleihen bewirbt, waren:

- THG-Emissionen
- CO₂-Fußabdruck
- THG-Intensität der Firmen, in die investiert wird
- Exponiertheit gegenüber Unternehmen mit Aktivitäten in fossilen Brennstoffen
- Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.
- Intensität des Energieverbrauchs je Sektor mit starken Auswirkungen auf das Klima
- Aktivitäten, die die Artenvielfalt in sensiblen Bereichen schädigen
- Emissionen in Wasser
- Anteil gefährlicher Abfälle
- Verstöße gegen die Grundsätze des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne
- Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne
- Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle
- Geschlechtervielfalt im Vorstand
- Exponiertheit gegenüber umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Kampfstoffe)

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

A. Spezifische Eingaben in die von der Anlageverwaltung eingesetzte ESG-Scoring-Methode, die mit den vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen im Einklang standen. Diese Informationen haben folgenden Ursprung:

1. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation und Brasilien.

B. Nachverfolgung der verpflichtenden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), die für den jeweiligen Emittenten relevant sind. Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

C. Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen (GSS) Anleihen mit 1,18 %. Die Verwendung der Erträge dieser Anleihen wurden von Emittenten angegeben (und durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft), und kamen den zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugute, wie zum Beispiel:

- Verringerung THG-Emissionen:
- Gestiegene Produktverfügbarkeit in Ländern mit niedrigen und mittleren Einkommen
- Schaffen von nachhaltigen Städten und eines sozialen Umfelds, in denen Transportwesen, Energie sowie Wasserversorgung und Hygiene nach ökologischen Aspekten gestaltet und finanziert werden können
- Initiativen zum Erreichen von Diversität, Chancengleichheit und Inklusion

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds investierte mindestens 1 % seines Nettovermögens in grüne und/oder soziale Anleihen, die nachhaltige Geldanlagen sind. Der Fonds investierte nur in Anleihen, bei denen der Emittent angab, wofür die Erträge verwendet werden (und bei denen diese Angaben durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft werden), und die zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugutekamen, wie zum Beispiel:

- Verringerung THG-Emissionen:
- Gestiegene Produktverfügbarkeit in Ländern mit niedrigen und mittleren Einkommen
- Schaffen von nachhaltigen Städten und eines sozialen Umfelds, in denen Transportwesen, Energie sowie Wasserversorgung und Hygiene nach ökologischen Aspekten gestaltet und finanziert werden können
- Initiativen zum Erreichen von Diversität, Chancengleichheit und Inklusion

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 (UNG) sowie Messdaten und KPIs im Zusammenhang mit den obligatorischen PAI-Prüfungen für Unternehmen und staatliche Emittenten. Für nachhaltige Geldanlagen in von Unternehmen ausgegebene Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf der Ebene des emittierenden Unternehmens. Für nachhaltige Geldanlagen in von staatlichen Stellen oder supranationalen Organisationen emittierte Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf Ebene der Ertragsverwendung (außer bei supranationalen Organisationen, deren spezifisches Leitbild vorsieht, dass alle finanzierten Aktivitäten/Projekte nachhaltig sein müssen).

Der Fonds überwachte die obligatorischen PAI-Werte, um Anlagen mit nachteiligen Auswirkungen zu ermitteln.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Dabei setzt die Anlageverwaltung zunächst auf aktive Zusammenarbeit mit den Emittenten und zieht sich erst als letzte Maßnahme aus einer Anlage zurück. Wurde ein wesentliches kurzfristiges Risiko entdeckt, veräußerte die Anlageverwaltung eine Anlage sofort.

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.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienen.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios.

Nicht alle obligatorischen PAIs waren inhärente Bestandteile der eigenen ESG-Bewertung für diesen Fonds. Die Anlageverwaltung verfolgte dennoch die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) nach und beobachtete diese.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emission: Reichweite 1 USD	47 610,47	60,85%
THG-Emission: Reichweite 2 USD	9 505,59	60,85%
THG-Emission: Reichweite 3 USD	195 058,19	59,70%
THG-Emission: Emissionen insgesamt (USD)	252 174,25	60,85%
CO2-Bilanz (USD)	353,95	60,85%
CO2-Intensität (USD)	960,36	63,67%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	4,57%	56,49%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	74,19%	26,47%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (USD)	0,00	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (USD)	2,21	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Fertigung (USD)	0,50	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (USD)	6,02	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	0,66	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Bauwesen (USD)	0,00	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (USD)	0,04	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (USD)	3,12	22,03%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (USD)	0,00	22,03%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	56,49%
Emissionen in Wasser (USD)	210,48	1,86%
Gefährliche Abfälle (USD)	433,96	9,94%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	59,25%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	44,00%	54,74%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	18,47%	5,64%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	29,84%	56,02%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	56,49%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	481,49	10,54%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	10,54%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
US TREASURY N/B 2.25% 02/15/52	Staatlich	1,79%	USA
DISH NETWORK 3.375% 08/15/26	Kommunikation	1,59%	USA
STACR 2021-DNA2 M2 FLT 08/25/33 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,44%	USA
TPMT 2018-2 B1 VAR 03/25/58 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,21%	USA
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	Grundstoffe	1,17%	Kanada
NEW FORTRESS 6.75% 09/15/25 144A	Energie	1,14%	USA
WFRBS 2014-LC14 D VAR 03/15/47 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	1,08%	USA
MILEAGE PLUS HLD 6.5% 06/20/27 144A	Zyklische Konsumgüter	1,06%	USA
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	Finanzen	0,95%	Brasilien
SPRINT SPECTRUM 5.152% 03/20/28 144A	Kommunikation	0,95%	USA
GRAHAM PKG CO IN 7.125% 08/15/28 144A	Industrie	0,92%	USA
CAS 2020-SBT1 2M2 FLT 02/25/40 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	0,91%	USA
TMIR 2021-3 M1A FLT 02/25/34 144A	Hypothekenbesicherte Wertpapiere (MBS)	0,86%	USA
ATHENE GLOBAL FU 0.914% 08/19/24 144A	Finanzen	0,85%	USA
VALERO ENERGY 3.65% 12/01/51	Energie	0,84%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

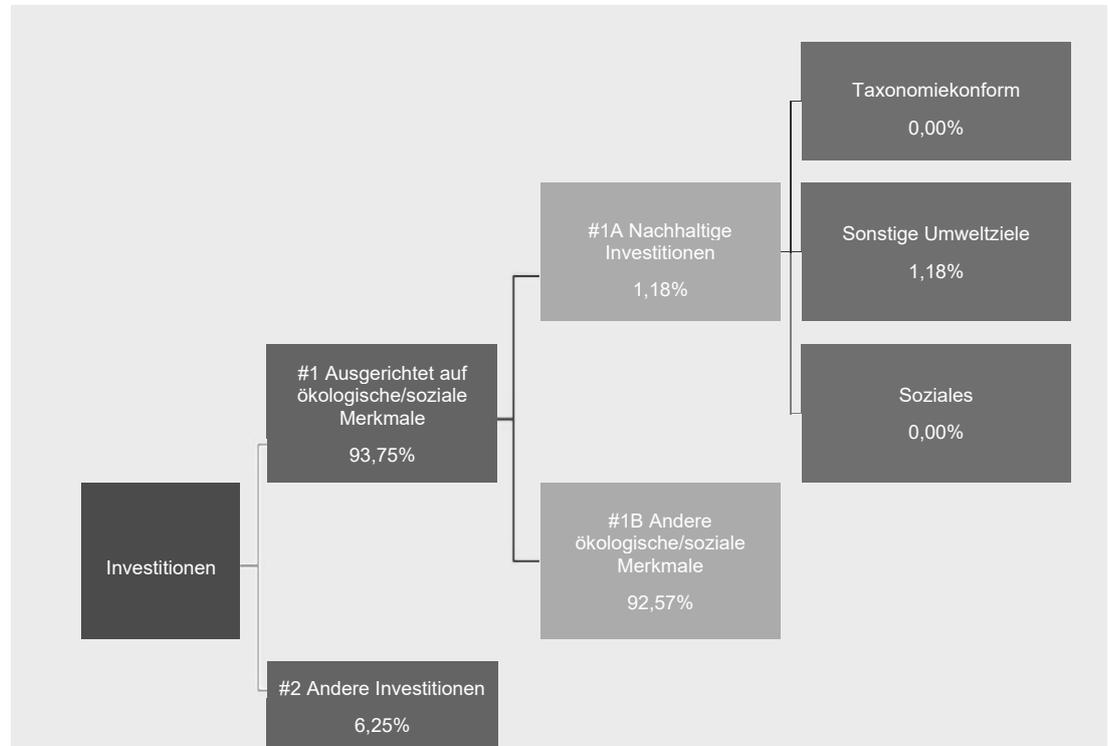
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 1,18 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

93,75 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (6,25 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 1,18 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
HYPOTHEKENWERTPAPIERE	18,79%
FINANZEN	16,64%
STAATLICH	11,90%
KOMMUNIKATION	11,23%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	8,85%
ENERGIE	6,57%
INDUSTRIE	6,12%
GRUNDSTOFFE	2,80%
TECHNOLOGIE	2,45%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	1,90%
VERSORGER	0,80%
DERIVATE	-0,38%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
STAATLICH	10,76%
INVESTMENTUNTERNEHMEN	9,12%
WL COLLAT CMO MEZZANINE	7,30%
WL COLLAT CMO SUBORDINAT	5,18%
UMBS SINGLE FAMILY 30YR	4,88%
FLUGGESELLSCHAFTEN	3,26%
OIL COMP-EXPLOR&PRODTN	2,92%
METALL-KUPFER	2,54%
TELEFON-INTEGRIERT	2,49%
PIPELINES	2,38%
CONTAINER-PAPIER/KUNSTSTOFF	2,31%
MOBILTELEKOM	1,77%
DIVERSIFIZIERTE KREDITINSTITUTE	1,71%
KABEL/SATELLITEN-TV	1,68%
AUTOMOBIL-PKW/KLEINE LKW	1,37%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem 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 Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

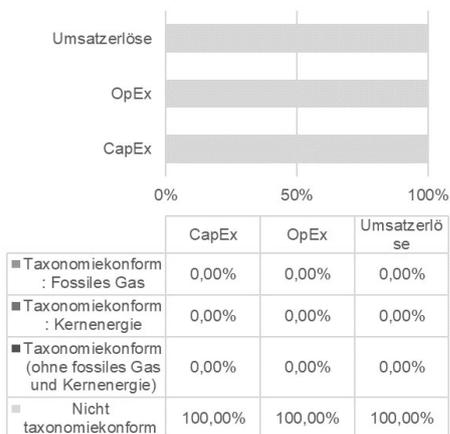
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

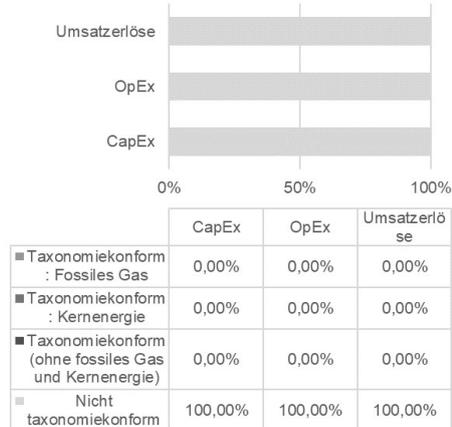
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet war, 1,18 %.

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Fonds investierte 0 % in sozial nachhaltige Anlagen.

- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 6,25 % 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. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen: Hercules Capital, Weibo Corp, Meta Platforms.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Carnival Cruise Corp., Dish Network Corp., Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation und Brasilien.
3. Bis zu 80 % der Investitionen wurden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von den Umweltschutz und/oder soziale Aspekte betreffenden Faktoren nachverfolgt und überwacht.
4. Der Fonds investierte mehr als 1 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900QDA77XG4LVMI92



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,30% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

Umwelt:

- Begrenzung der Auswirkungen des Klimawandels;
- Anpassung an den Klimawandel;
- Wasser und
- Artenvielfalt.

Soziales:

- Chancengleichheit.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen zu den schwächsten 10 % zählten (niedrigstes Dezil), wurden während des Berichtszeitraums aus dem investierbaren Anlageuniversum ausgeschlossen.

Emittenten, die hinsichtlich der Bewertungen in die Spanne zwischen die unteren 10 % und 20 % fallen (zweitniedrigstes Dezil), wurden als Kandidaten während des Berichtszeitraums behandelt.

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: Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation und Brasilien.

B. Nachverfolgung der verpflichtenden Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren). Siehe dazu die Werte im Abschnitt „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“

C. Darüber hinaus beobachtete der Anlageverwalter den Anteil des Portfolios, der an den Leistungskennzahlen in Bezug auf Nachhaltigkeit (KPIs) ausgerichtet war, die für den jeweiligen Emittenten relevant waren, siehe folgende Tabelle:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
CO2-Reichweite 1 -> Niedriger	1,21%
Stromverbrauch -> Niedriger	1,22%
Energie pro gefertigter Einheit -> Niedriger	2,38%
Faire Vergütungsrichtlinie / Implementierung (J/N)	0,95%
Bereinigung geschlechtsspezifisches Lohngefälle / Implementierung (J/N)	2,33%
THG-Intensität bzgl. Umsatz -> Niedriger	11,16%
THG-Intensität pro Fahrzeug -> Niedriger	1,25%
THG-Reichweite 1 -> Niedriger	9,44%
THG-Reichweite 3 -> Niedriger	1,99%
Menschenrechtsrichtlinie / Implementierung (J/N)	0,76%
Investitionen in Nachhaltigkeit -> Höher	2,30%
Geschlechtsspezifisches Lohngefälle in Prozent, Mitarbeiter einschl. Management -> Niedriger	1,24%
Berücksichtigung von Minderheiten in Prozent -> Höher	0,97%
Recycelte Stoffe in Prozent -> Höher	1,00%
Richtlinien gegen Kinderarbeit / Implementierung (J/N)	0,78%
Nutzung von erneuerbarer Energie -> Höher	4,15%
Verwaltete nachhaltige ESG-Ressourcen -> Höher	2,57%
Kreditvergabe bzgl. nachhaltiger ESG-Ressourcen, Feldbewertung -> Höher	1,32%
Wasserverbrauch gesamt -> Niedriger	0,97%
Recycelter Abfall -> Höher	1,01%
Wasserrichtlinie / Implementierung (J/N)	0,75%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Der Fonds investierte mindestens 15 % seines Nettovermögens in grüne/soziale/nachhaltige/nachhaltigkeitsbezogene Anleihen sowie in bestimmte Emittenten, die vom Anlageverwalter als nachhaltige Investitionen eingestuft wurden. Der Fonds investierte nur in Anleihen, bei denen der Emittent angab, wofür die Erträge verwendet werden (und bei denen diese Angaben durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft werden), und die zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugutekamen, wie zum Beispiel:

- Umwelt:
 - Klimaschutz
 - Anpassung an den Klimawandel
 - Wasserschutz
 - Bewahrung/Nutzung/Recycling
 - Beobachtung und Schutz der Artenvielfalt

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, Nachrichten, Angaben zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) und ESG-Daten von externen Anbietern. Für nachhaltige Geldanlagen in von Unternehmen ausgegebene Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf der Ebene des emittierenden Unternehmens. Für nachhaltige Geldanlagen in von staatlichen Stellen oder supranationalen Organisationen emittierte Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf Ebene der Ertragsverwendung (außer bei supranationalen Organisationen, deren spezifisches Leitbild vorsieht, dass alle finanzierten Aktivitäten/Projekte nachhaltig sein müssen).

Die Anlageverwaltung prüfte sämtliche bei Screening-Prüfungen von Drittanbietern angezeigten öffentlichen Sanktionen im Zusammenhang mit der Nichteinhaltung des UN Global Compact (UNGC) sowie Messdaten und KPIs im Zusammenhang mit den obligatorischen PAI-Prüfungen für Unternehmen und staatliche Emittenten.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zudem Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, um Chancen für Verbesserungen und Impact zu bewerten. Daher dienten sie als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen.

Bei der Identifikation nachhaltiger Investitionen oder der Feststellung, wo Verbesserungen im Nachhaltigkeitsprofil erforderlich waren, wurden obligatorische PAIs berücksichtigt. Außer bei PAI 10 (Verstöße gegen UNGC-Prinzipien und OECD-Richtlinien für multinationale Unternehmen) und PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen), wurden PAI-Indikatoren als KPIs zur Nachverfolgung und Beobachtung des Fortschritts der Emittenten verwendet, in die investiert wird (wie weiter unten in dieser Anlage beschrieben). Verschlechtern sich die PAI-Indikatoren oder fehlen sie ganz, ist ein aktives Engagement zwingend vorgeschrieben, ebenso bei Bedarf eine Veräußerung des Titels und/oder ein Ausschluss aus dem Anlageuniversum.

Unternehmen mit PAI 10 oder die in PAI 14 involviert waren und Länder, die gegen soziale Bestimmungen verstießen (PAI 16), wurden vom Anlageuniversum ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Optionale PAIs und Daten in Bezug auf die EU-Taxonomie waren im Zuge ihrer Verfügbarkeit mit ausreichender Abdeckung Bestandteil der DNSH-Bewertung.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung verfolgte Verstöße gegen OECD/UNGC-Grundsätze (die automatisch von Dritten eingeholt werden) und Versäumnisse; Unternehmen, die sich nicht daran hielten, werden vom Portfolio/Anlageuniversum ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios.

Nicht alle obligatorischen PAIs waren inhärente Bestandteile der eigenen ESG-Bewertung für diesen Fonds. Die Anlageverwaltung verfolgte dennoch die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) nach und beobachtete diese.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Reichweite 1 USD	736,47	66,42%
THG-Emissionen: Reichweite 2 USD	141,25	66,42%
THG-Emissionen: Reichweite 3 USD	4 911,81	66,42%
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	5 789,53	66,42%
CO ₂ -Bilanz (USD)	600,19	66,42%
THG-Intensität (USD)	1 311,56	72,02%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	6,82%	68,33%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	69,14%	36,63%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (USD)	0,00	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (USD)	2,22	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Fertigung (USD)	0,27	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (USD)	6,02	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (USD)	0,00	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Bauwesen (USD)	0,00	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (USD)	0,08	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (USD)	1,68	35,55%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (USD)	0,00	35,55%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	68,33%
Emissionen in Wasser (USD)	0,23	1,03%
Gefährliche Abfälle (USD)	0,79	16,57%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	70,21%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	47,75%	67,29%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	24,63%	8,16%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	33,83%	65,83%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	68,33%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (USD)	369,41	12,58%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	12,58%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
STACR 2022-HQA2 M1B FLT 07/25/42 144A	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	4,14%	USA
CAS 2022-R01 1M2 FLT 12/25/41 144A	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	3,90%	USA
STACR 2021-DNA7 M2 FLT 11/25/41 144A	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	3,86%	USA
BRAZIL NTN-F 10% 01/01/33	STAATLICH	2,42%	Brasilien
FNCL MA4733 4.5% 09/01/52	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	2,27%	USA
DEUTSCHLAND REP 1.7% 08/15/32	STAATLICH	2,25%	Deutschland
FRANCE O.A.T. 0% 05/25/32	STAATLICH	2,20%	Frankreich
CAS 2022-R04 1M1 FLT 03/25/42 144A	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	1,75%	USA
FNCL SD8245 4.5% 09/01/52	HYPOTHEKENWERTPAPIERE	1,62%	USA
BTPS 2.5% 12/01/32	STAATLICH	1,46%	Italien
AES PANAMA GENER 4.375% 05/31/30	VERSORGER	1,43%	Panama
FIRST QUANTUM 6.875% 10/15/27 144A	GRUNDSTOFFE	1,42%	Kanada
VAR ENERGI ASA 7.5% 01/15/28 144A	ENERGIE	1,41%	Norwegen
XP INC 3.25% 07/01/26 144A	FINANZEN	1,41%	Brasilien
KENBOURNE INVEST 6.875% 11/26/24	KOMMUNIKATION	1,40%	Luxemburg



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

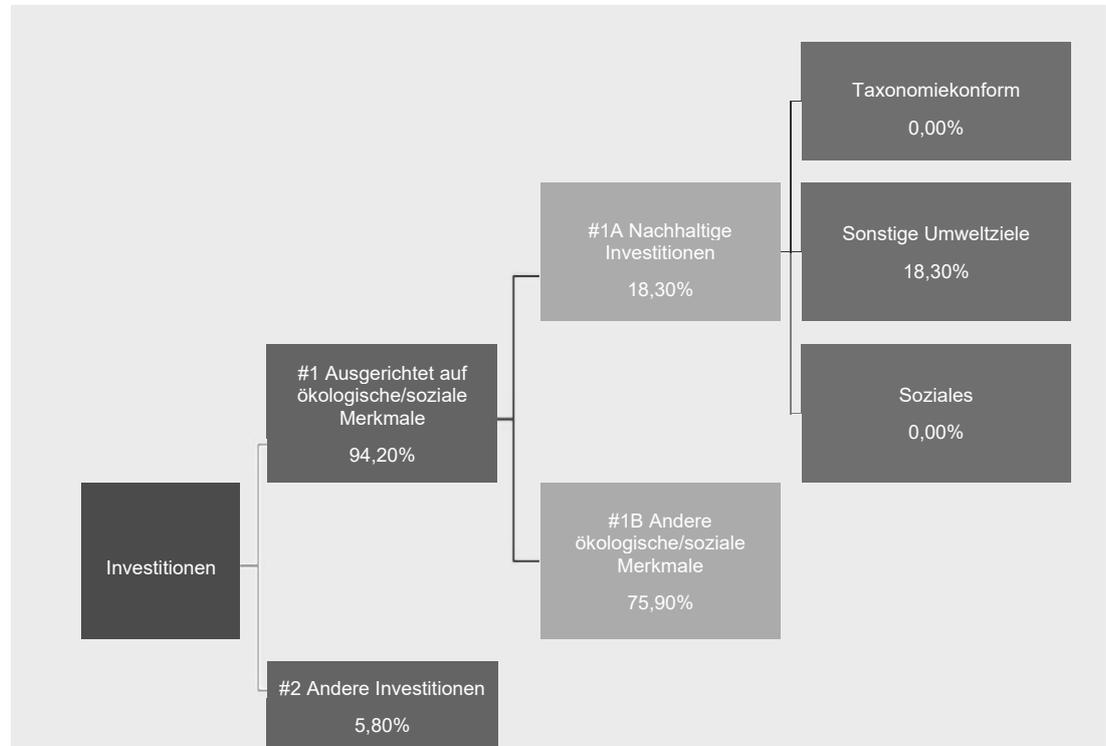
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 18,30 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,20 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 18,30 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
HYPOTHEKENWERTPAPIERE	18,64%
STAATLICH	16,61%
FINANZEN	14,89%
ENERGIE	11,63%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	8,06%
INDUSTRIE	6,20%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	5,46%
GRUNDSTOFFE	3,52%
VERSORGER	3,47%
KOMMUNIKATION	3,45%
TECHNOLOGIE	2,27%
Derivate	-1,41%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
STAATLICH	12,67%
WL COLLAT CMO MEZZANINE	9,79%
DIVERSIFIZIERTE KREDITINSTITUTE	7,63%
OIL COMP-EXPLOR&PRODTN	7,35%
AUTOMOBIL-PKW/KLEINE LKW	5,89%
UMBS SINGLE FAMILY 30YR	4,99%
SUPRANATIONALE BANK	3,95%
WL COLLAT CMO SUBORDINAT	3,86%
INVESTMENTUNTERNEHMEN	2,80%
METALL-KUPFER	2,51%
LEBENSMITTEL-FLEISCHPRODUKTE	2,39%
FLUGGESELLSCHAFTEN	2,17%
CONTAINER-PAPIER/KUNSTSTOFF	2,09%
TELEFON-INTEGRIERT	2,05%
MEDIZIN-KRANKENHÄUSER	2,01%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

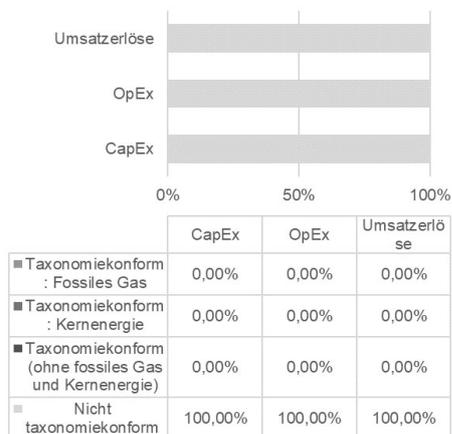
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

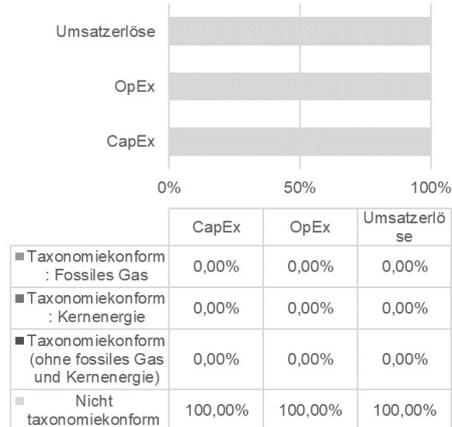
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen zum Ende des Berichtszeitraums Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 18,30 %.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds investierte 0 % in sozial nachhaltige Anlagen.



Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 5,80 % 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. Der Fonds setzte 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: Taseko Mines Ltd., Owl Rock Capital Corporation und Brasilien.
3. Mindestens 90 % der Schuldtitel und/oder schuldbezogenen Titel werden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von Umweltschutz- und sozialen Faktoren nachverfolgt und überwacht.
4. Der Fonds investierte mehr als 15 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF ClearBridge Value Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300OZGGIQZ97B7W66



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 29,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale 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 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:

- Alle nachteiligen Auswirkungen (PAI), die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung sind, insbesondere PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“;
- Der Prozentsatz des Portfolios mit einem Rating von B laut des eigenen ESG-Ratingsystems des Anlageverwalters, das bei 0 % lag.
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Der Fond fällt in das Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	20,65%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	16,06%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der Ziele der UN für nachhaltige Entwicklung (SDG) und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 22 % des Portfolios
- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 20 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

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.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendete Daten von Drittanbietern für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Umsätze generieren aus (a) ausgeschlossenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	747 211,99	96,45%
CO ₂ -Bilanz (USD)	877,12	96,45%
THG-Intensität (USD)	1 977,90	98,96%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien oder die OECD-Leitsätze	0,00%	98,96%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	34,34%	94,40%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	94,40%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
WELLS FARGO & CO	Finanzen	3,23%	USA
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC	Finanzen	3,15%	USA
BANK OF AMERICA CORP	Finanzen	3,12%	USA
EQT CORP	Energie	3,05%	USA
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	Energie	2,90%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	2,58%	USA
META PLATFORMS INC	Kommunikationsdienste	2,53%	USA
FREEMPORT-MCMORAN INC	Grundstoffe	2,43%	USA
ORACLE CORP	Informationstechnologie	2,32%	USA
PFIZER INC	Gesundheitssektor	2,28%	USA
ABBVIE INC	Gesundheitssektor	2,25%	USA
AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	Versorgungsunternehmen	2,24%	USA
AES CORP/THE	Versorgungsunternehmen	2,23%	USA
ENBRIDGE INC	Energie	2,15%	Kanada
CIGNA CORP	Gesundheitssektor	2,14%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

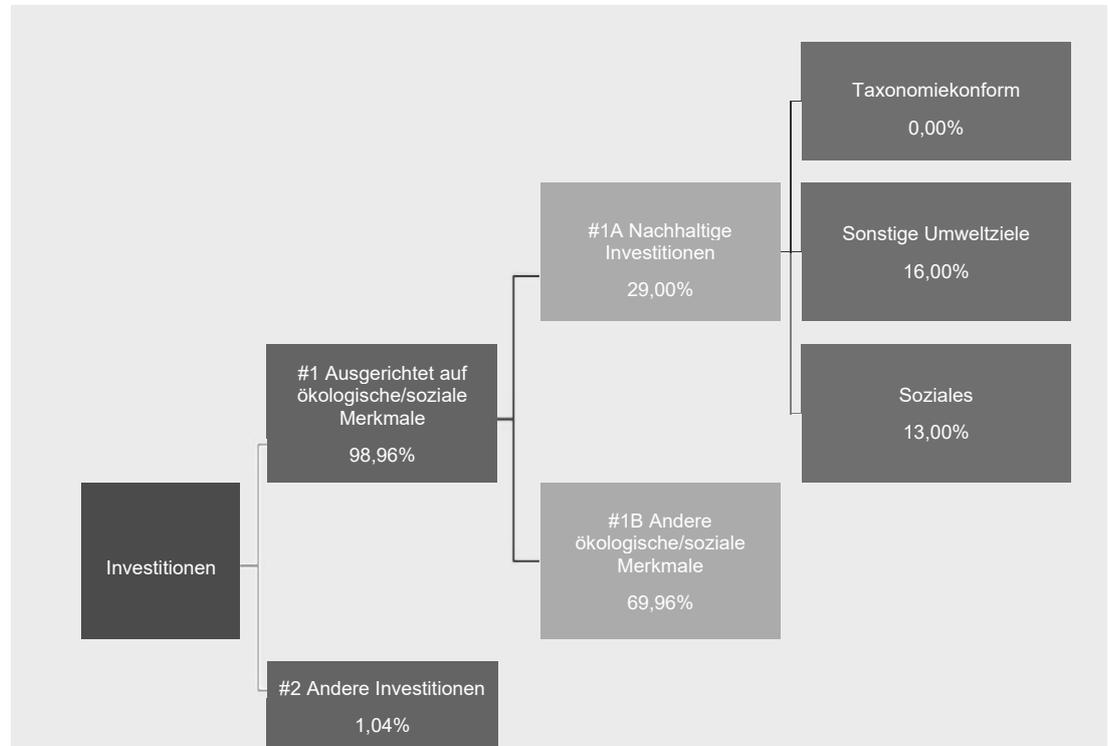
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 29,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 98,96 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (<1,98 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestanden aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 29,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	20,43%
Gesundheitssektor	17,74%
Energie	17,48%
Versorgungsunternehmen	7,67%
Industrie	7,59%
Grundstoffe	7,15%
Informationstechnologie	6,94%
Zyklische Konsumgüter	4,83%
Kommunikationsdienste	4,63%
Basiskonsumgüter	3,66%
immobilien	0,84%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Öl, Gas und nicht-erneuerbare Brennstoffe	11,73%
Banken	9,11%
Biotechnologie	6,53%
Gesundheitsdienstleister und -dienstleistungen	5,94%
Energieausrüstung und -dienstleistungen	5,74%
Metalle und Bergbau	5,34%
Versicherungen	4,33%
Unabhängige Strom- und erneuerbare Elektrizitätsproduzenten	4,11%
Hotels, Restaurants und Freizeit	3,81%
Software	3,56%
Stromversorger	3,55%
Pharmazie	3,28%
Kapitalmärkte	3,16%
Interaktive Medien und Dienstleistungen	2,95%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,39%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

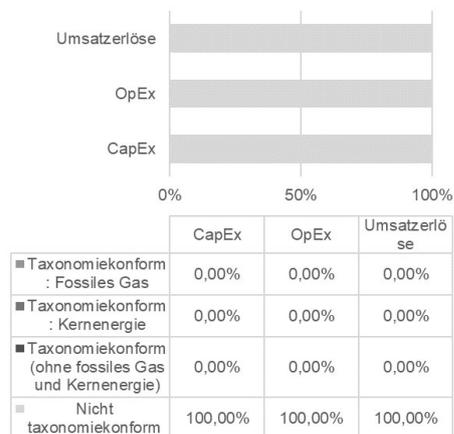
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

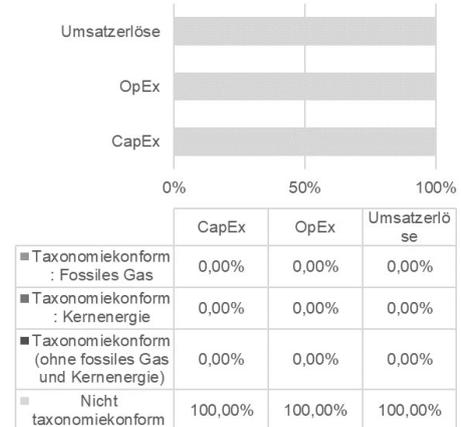
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 16,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 13,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,04 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 13%

AA: 50%

A: 37%

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.

Darüber hinaus tauschte sich der Anlageverwalter regelmäßig direkt mit den Unternehmen mit einem B-Rating, in die der Fonds investiert, aus, um die wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Merkmale dieser Unternehmen zu verbessern.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung hier: <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

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

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF ClearBridge US Appreciation Fund

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 Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 59,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 5 % 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 Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen („SDG“). Diese betragen 41 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“:
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:
 - AAA: 42 %
 - AA: 41 %
 - A: 17 %
 - B: 0 %

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 41 % des Portfolios
- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht. 45 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

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.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Treminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	67 906,15	95,72%
CO ₂ -Bilanz (USD)	381,67	95,72%
THG-Intensität (USD)	886,78	95,72%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,72%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	35,65%	95,72%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	95,72%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	7,57%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	6,05%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	3,54%	USA
BERKSHIRE HATHAWAY INC	Finanzen	3,36%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	3,15%	USA
JPMORGAN CHASE & CO	Finanzen	2,74%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,71%	USA
VISA INC	Informationstechnologie	2,69%	USA
TRAVELERS COS INC	Finanzen	2,57%	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Gesundheitssektor	2,53%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	2,51%	USA
MERCK & CO INC	Gesundheitssektor	2,49%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	2,44%	USA
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	Industrie	2,44%	USA
AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	Informationstechnologie	2,06%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

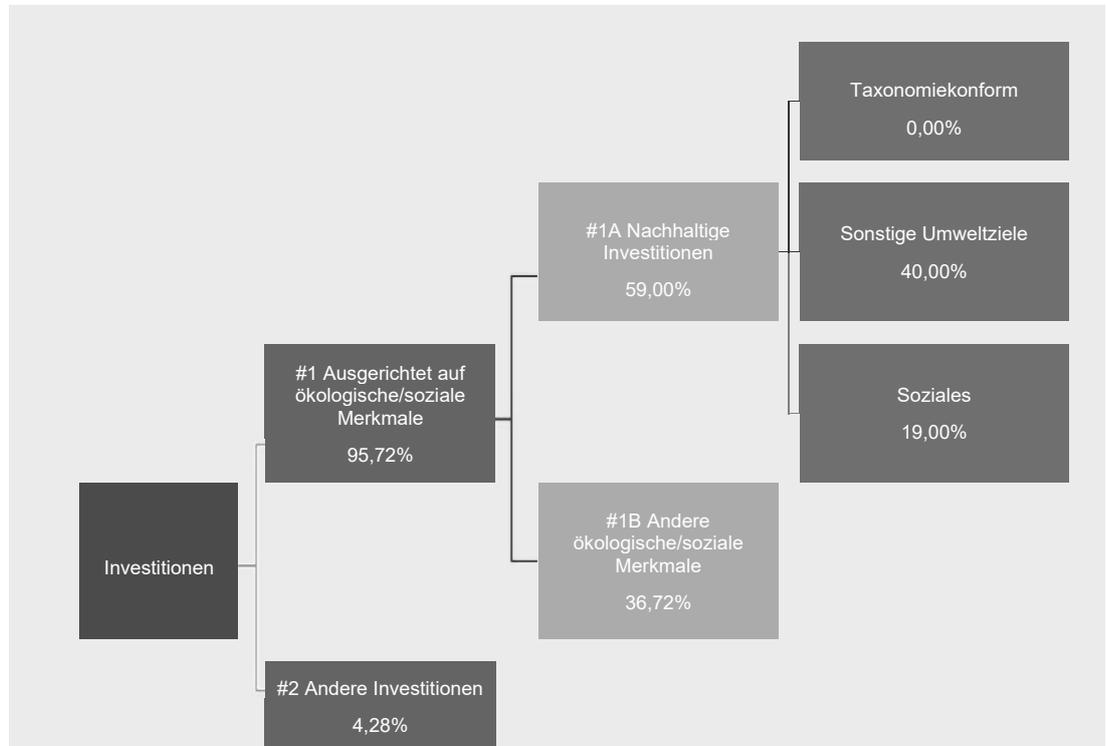
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 59,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,72 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (4,28 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 59,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	21,54%
Gesundheitssektor	16,88%
Finanzen	14,34%
Industrie	9,21%
Zyklische Konsumgüter	7,44%
Grundstoffe	7,30%
Basiskonsumgüter	7,22%
Kommunikationsdienste	7,11%
Energie	2,39%
immobilien	1,34%
Versorgungsunternehmen	0,94%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Software	9,19%
Pharmazie	8,73%
IT-Dienstleistungen	5,24%
Banken	5,08%
Chemische Erzeugnisse	4,89%
Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	4,86%
Versicherungen	4,35%
Fachhandel	4,32%
Gesundheitsdienstleister und -dienstleistungen	3,64%
Finanzdienstleistungen	3,53%
Interaktive Medien und Dienstleistungen	3,21%
Getränke	3,07%
Industriekonzerne	2,81%
Öl, Gas und nicht-erneuerbare Brennstoffe	2,39%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	2,26%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

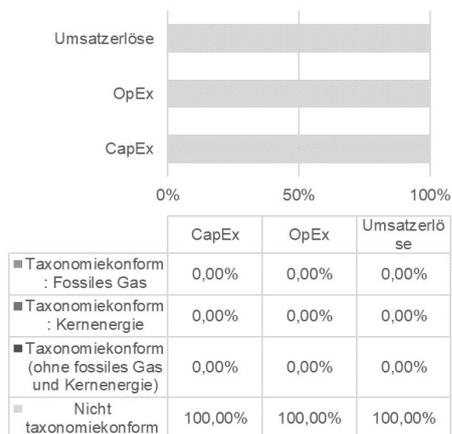
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

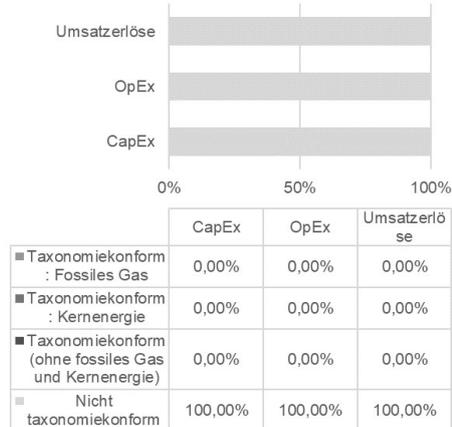
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 40,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 19,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 4,28 % 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 benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 42 %

AA: 41 %

A: 17 %

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 hier: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen eines oder mehrere der zehn Prinzipien in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 65,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 20 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

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 Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen („SDG“). Diese betragen 39 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Alle nachteiligen Auswirkungen (PAI), nämlich PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“;
- eigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßige ESG-Engagement-Meetings mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:
 - AAA: 48%
 - AA: 34%
 - A: 18%
 - B: 0%

Der Fonds gehört zum Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten, bewertet.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	44,24%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	23,62%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 39 % des Portfolios
- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 44 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

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?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendete Daten von Drittanbietern für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	106 503,87	95,26%
CO ₂ -Bilanz (USD)	97,02	95,26%
THG-Intensität (USD)	465,22	95,26%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,26%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	34,89%	95,26%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	95,26%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	4,14%	USA
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	3,62%	USA
VISA INC	Informationstechnologie	2,61%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	2,38%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	2,29%	USA
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	1,80%	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Gesundheitssektor	1,62%	USA
PALO ALTO NETWORKS INC	Informationstechnologie	1,54%	USA
NETFLIX INC	Kommunikationsdienste	1,44%	USA
META PLATFORMS INC	Kommunikationsdienste	1,43%	USA
S&P GLOBAL INC	Finanzen	1,26%	USA
SALESFORCE INC	Informationstechnologie	1,26%	USA
WW GRAINGER INC	Industrie	1,18%	USA
UNITED PARCEL SERVICE INC	Industrie	1,15%	USA
EATON CORP PLC	Industrie	1,14%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

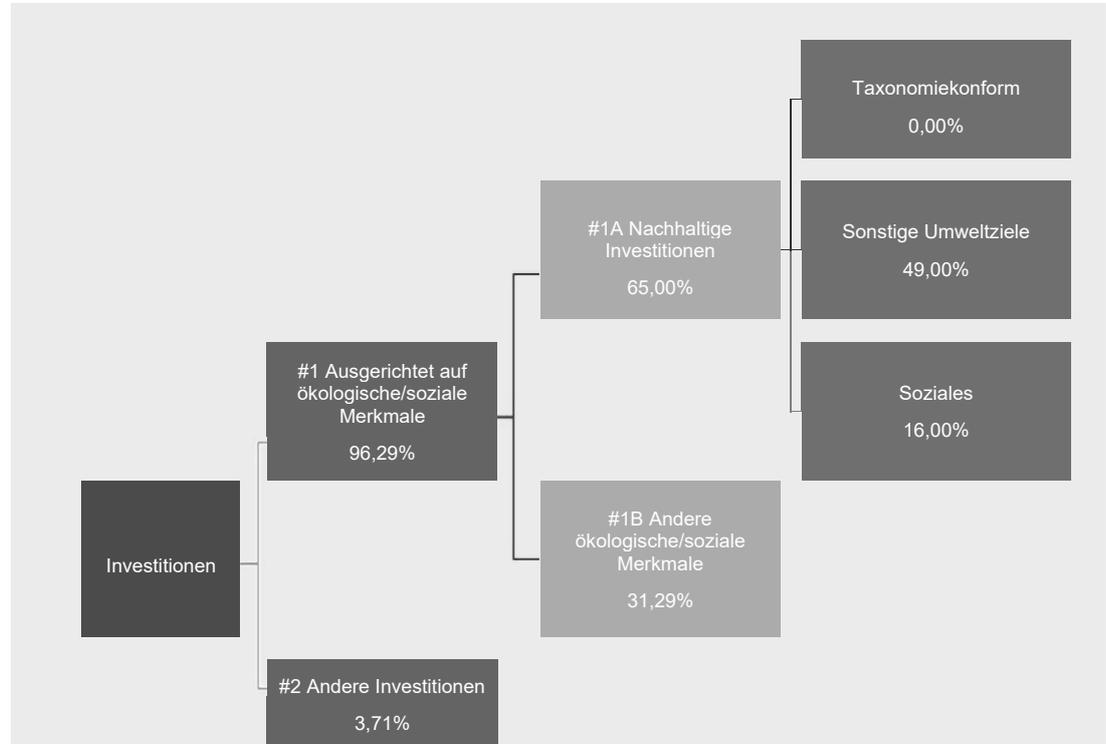
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 65,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Mindestens 96,29 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,71 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 65,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	35,09%
Gesundheitssektor	19,69%
Zyklische Konsumgüter	11,50%
Industrie	11,36%
Kommunikationsdienste	5,36%
Basiskonsumgüter	4,50%
Finanzen	4,29%
immobilien	1,73%
Grundstoffe	1,62%
Versorgungsunternehmen	1,14%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Gerätefertigung	7,56%
Haushaltsartikel und Körperpflegeprodukte	7,18%
Kundenkreditgeschäft	7,04%
Biotechnologie und Pharmazie	6,90%
Ausrüstung und Zubehör für das Gesundheitswesen	6,76%
Managed Care	6,62%
Gasversorgung und -verteilung	6,49%
immobilien	6,36%
Biobrennstoffe	6,23%
Brennstoffzellen und Industriebatterien	6,11%
Kasinos und Glücksspiel	5,99%
Medien und Unterhaltung	5,87%
Halbleiter	5,75%
Software und IT-Dienstleistungen	5,64%
Fahrzeugteile	5,52%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

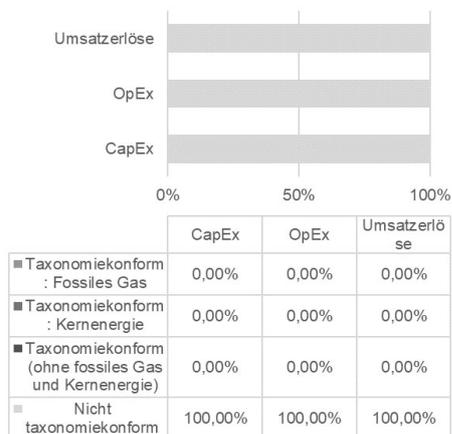
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

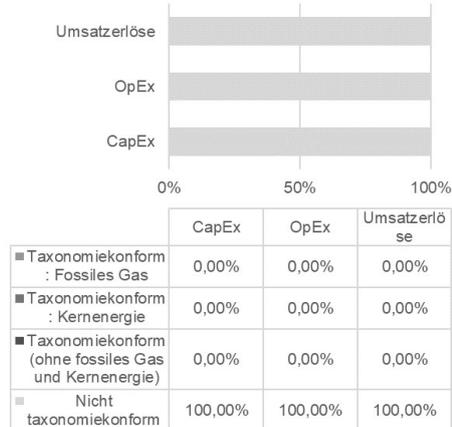
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 49,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 16,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 3,71 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 48%

AA: 34%

A: 18%

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 hier: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493007ZJMPVPNDQMY52



FRANKLIN TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 46,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 5 % 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 Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen („SDG“). Diese betragen 35 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“;
- eigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßige ESG-Engagement-Meetings mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:
 - AAA: 21%
 - AA: 59%
 - A: 20%
 - B: 0%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 35 % des Portfolios
- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht. 24 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

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.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Treminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	137 578,85	98,79%
CO ₂ -Bilanz (USD)	667,17	98,79%
THG-Intensität (USD)	9 124,64	98,79%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,79%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	31,64%	98,79%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	98,79%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	8,53%	USA
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Gesundheitssektor	8,23%	USA
BROADCOM INC	Informationstechnologie	7,73%	USA
TE CONNECTIVITY LTD	Informationstechnologie	6,88%	USA
COMCAST CORP	Kommunikationsdienste	5,74%	USA
WOLFSPEED INC	Informationstechnologie	4,54%	USA
AUTODESK INC	Informationstechnologie	4,20%	USA
BIOGEN INC	Gesundheitssektor	3,33%	USA
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC	Informationstechnologie	3,20%	USA
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Industrie	3,14%	USA
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP	Kommunikationsdienste	2,90%	USA
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PLC	Informationstechnologie	2,83%	USA
HUBSPOT INC	Informationstechnologie	2,53%	USA
TWITTER INC	Informationstechnologie	2,39%	USA
IONIS PHARMACEUTICALS INC	Gesundheitssektor	2,16%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

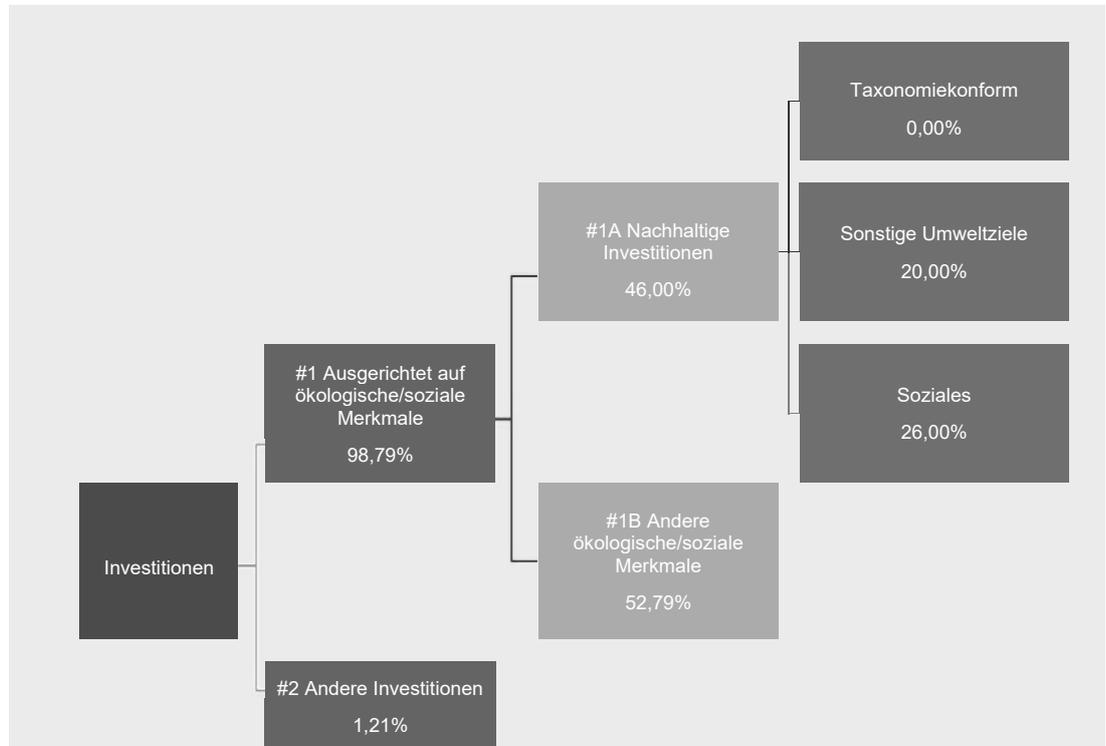
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 46,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,79 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,21 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 46,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	37,58%
Gesundheitssektor	33,15%
Kommunikationsdienste	16,29%
Industrie	4,87%
Zyklische Konsumgüter	3,78%
Basiskonsumgüter	1,64%
Grundstoffe	0,84%
Finanzen	0,64%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Biotechnologie	18,01%
Software	13,24%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	12,80%
Gesundheitsdienstleister und -dienstleistungen	9,32%
Medien	7,99%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	7,65%
Unterhaltung	7,25%
Baustoffe	4,28%
Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	2,91%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	2,54%
Ausrüstung und Zubehör für das Gesundheitswesen	2,41%
Biowissenschaftliche Hilfsmittel und Dienstleistungen	2,23%
Getränke	1,64%
Hotels, Restaurants und Freizeit	1,24%
Gesundheitstechnologie	1,19%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

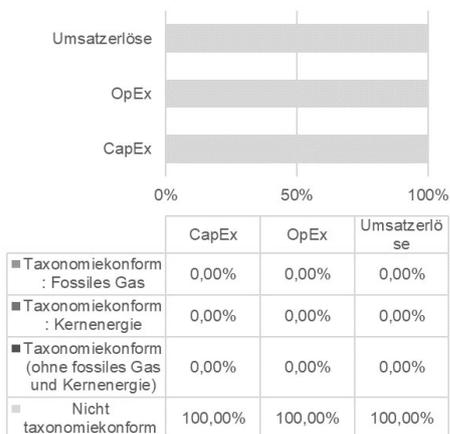
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

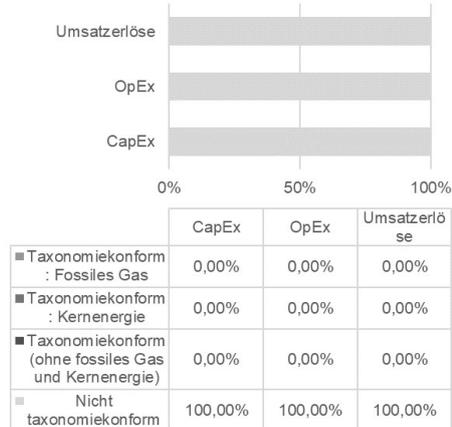
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 20,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 26,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,21 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 21%

AA: 59%

A: 20%

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 hier: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund



Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300RLIXEW79ZF0B12

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input type="radio"/> JA	<input checked="" type="radio"/> NEIN
<input type="checkbox"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> 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"/> Damit wurden nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 81,00% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel <input type="checkbox"/> Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt .



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Berichtszeitraums investierte die Anlageverwaltung als Teil ihrer Anlagepolitik in Unternehmen mit unterschiedlicher Marktkapitalisierung und unterstützte somit starke oder sich verbessernde ökologische, soziale und Governance- („ESG“) Merkmale. Der Fonds ermittelt anhand eines etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozesses, ob ein Unternehmen ein Sustainability Leader ist. Dieser firmeneigene Prozess ergibt ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Diese Merkmale umfassten unter anderem:

- Energieeffizienz,
- Saubere Energie,
- Ermöglichende Technologien zur Verringerung des Kohlenstoffausstoßes,
- Wassereffizienz,
- Verfahren zur Reduzierung von Materialverschwendung,
- Vielfalt der Belegschaft,
- Gesundheit und Wohlergehen,
- Lohngerechtigkeit,
- Überwachung der Lieferkette sowie
- Engagement für die Gemeinschaft.

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:

- Der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen („SDG“). Diese betragen 63 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Spezifische Indikatoren nachteiliger Auswirkungen (PAI), nämlich PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im fossilen Brennstoffsektor tätig sind), PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“;
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Das Engagement des Portfolios bei Best-in-Class-Unternehmen, wie es mit dem firmeneigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung definiert wurde. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds mit Stand vom 31.12.2022 beträgt:
 - AAA: 63%
 - AA: 35%
 - A: 2%
 - B: 0%
- Der Fonds gehört zum Netto-Null-Ziel von ClearBridge und wurde in Bezug auf den Anteil der Unternehmen bewertet, die sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	50,51%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	12,07%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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:

- durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Ziele der SDGs und den ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren, wobei ihr Beitrag durch die Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wird, oder
- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten werden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht.

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.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

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?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor 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 (Aktivitäten, die sich negativ auf biodiversitätssensible Gebiete 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 Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen, Streumunition, weißer Phosphor).

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	1 514 149,99	98,66%
CO ₂ -Bilanz (USD)	973,99	98,66%
THG-Intensität (USD)	1 881,15	98,66%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	3,78%	98,66%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	98,66%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,66%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	34,46%	98,66%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	98,66%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	6,40%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	5,11%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	3,20%	USA
COSTCO WHOLESALE CORP	Basiskonsumgüter	2,59%	USA
CVS HEALTH CORP	Gesundheitssektor	2,44%	USA
BANK OF AMERICA CORP	Finanzen	2,42%	USA
PROGRESSIVE CORP	Finanzen	2,34%	USA
HOME DEPOT INC/THE	Zyklische Konsumgüter	2,13%	USA
HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC	Finanzen	2,12%	USA
DANAHER CORP	Gesundheitssektor	2,06%	USA
GILEAD SCIENCES INC	Gesundheitssektor	2,05%	USA
MORGAN STANLEY	Finanzen	2,05%	USA
MCCORMICK & CO INC	Basiskonsumgüter	2,02%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	1,98%	USA
REGAL REXNORD CORP	Industrie	1,95%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

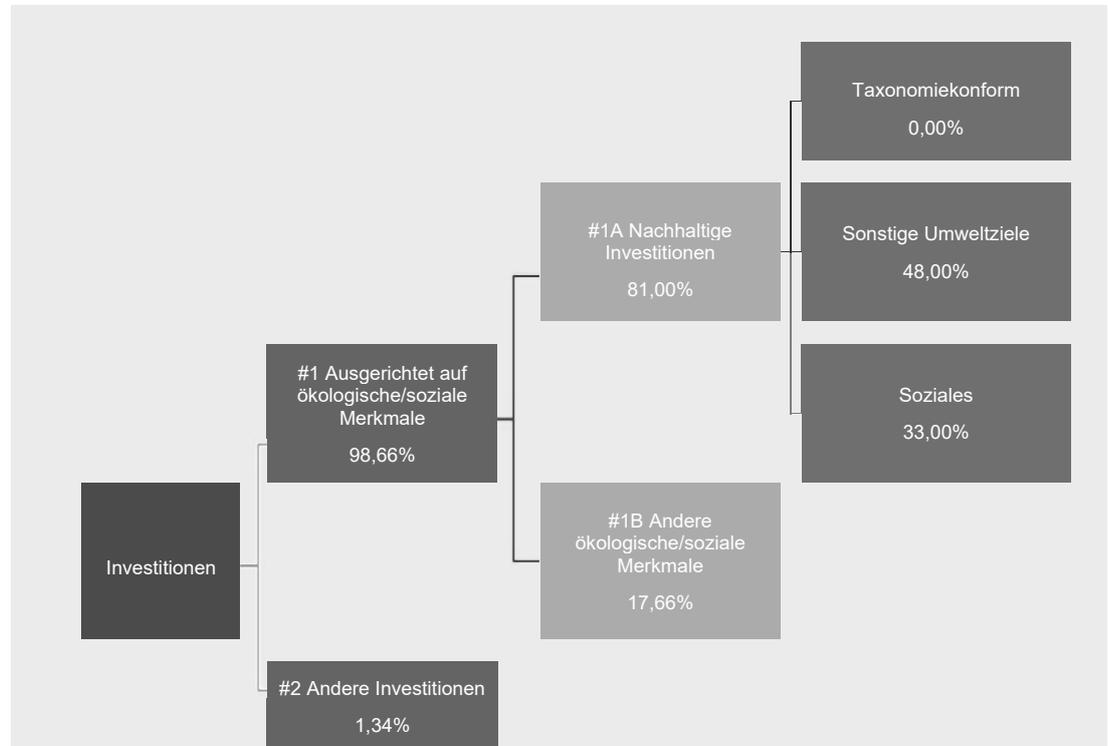
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 81,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,66 % des Portfolios des Fonds 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 aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 81,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	27,91%
Gesundheitssektor	19,46%
Finanzen	14,41%
Industrie	11,17%
Zyklische Konsumgüter	9,60%
Basiskonsumgüter	4,35%
Kommunikationsdienste	3,41%
immobilien	2,92%
Grundstoffe	2,76%
Versorgungsunternehmen	2,68%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Software	8,52%
Gesundheitsdienstleister und -dienstleistungen	6,40%
Elektronikgeräte	5,88%
Kapitalmärkte	5,77%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	5,46%
Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	4,62%
Versicherungen	4,41%
Banken	4,22%
Biowissenschaftliche Hilfsmittel und Dienstleistungen	3,97%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	3,86%
Pharmazie	3,79%
Biotechnologie	3,76%
IT-Dienstleistungen	3,56%
Fachhandel	3,48%
Baustoffe	2,97%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

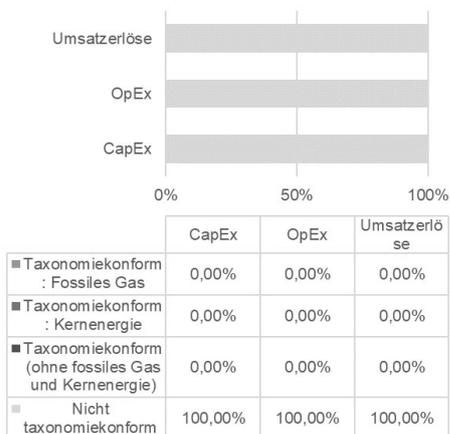
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

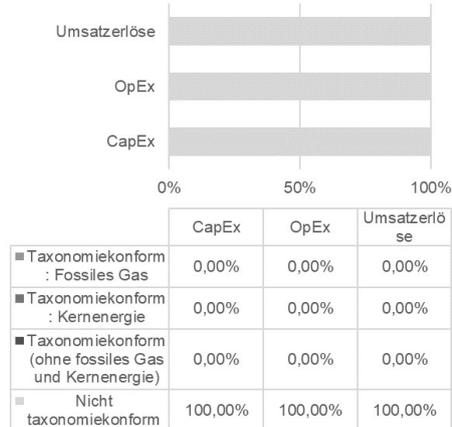
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichte Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 48,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 33,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,34 % 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 führende Unternehmen beim Thema Nachhaltigkeit zu identifizieren, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Anlageverwaltung betrachtet AAA und AA als „Best-in-Class“. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 63%

AA: 35%

A: 2%

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 hier: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Fossile Brennstoffe
- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Konventionelle Waffen
- Kernkraft
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 59,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren ergibt ein ESG-Ratingsystem, bei dem eine Wesentlichkeitskarte benutzt wurde, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale sind wichtige Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehören 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 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 Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, darunter die Ausrichtung des Produkts und/oder der Dienstleistung an den Nachhaltigen Entwicklungszielen der Vereinten Nationen („SDG“). Diese betragen 35 %. Hinzu kommt die Berücksichtigung der DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm).
- Bestimmte Indikatoren für wichtigste nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), und zwar: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Bilanz), PAI Nr. 3 (THG-Intensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den Global Compact der Vereinten Nationen und die OECD-Leitsätze), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“:
- Firmeneigene Methoden, um die Fortschritte der ESG-Engagement-Meetings des Anlageverwalters zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den firmeneigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.
- Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:
 - AAA: 38%
 - AA: 44%
 - A: 18%
 - B: 0%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Punkte leisteten:

• Unternehmen, die durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wurde; 35 % des Portfolios

und/oder

- Zielsetzung für die THG-Intensität und die Emissionsreduzierung in allen Wirtschaftstätigkeiten eines Unternehmens, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird. Die Emittenten wurden im Rahmen unseres Engagement-Prozesses hinsichtlich ihrer Fortschritte bei der Erreichung der Ziele überwacht; 48 % des Portfolios

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung des Anlageverwalters im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **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 Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilssektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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.

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses fungierte.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAI, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewendet wurde, insbesondere:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung führte eine Analyse der Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens insgesamt durch, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	1 295,82	96,85%
CO ₂ -Bilanz (USD)	104,70	96,85%
THG-Intensität (USD)	486,01	98,22%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,22%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	36,36%	95,59%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	95,59%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	4,22%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	3,58%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	2,63%	USA
UNION PACIFIC CORP	Industrie	2,42%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	2,31%	USA
DIAGEO PLC	Basiskonsumgüter	2,30%	Vereinigtes Königreich
AIA GROUP LTD	Finanzen	2,22%	Hongkong
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	2,11%	USA
KROGER CO	Basiskonsumgüter	2,04%	USA
NESTLE SA	Basiskonsumgüter	1,93%	USA
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Gesundheitssektor	1,79%	USA
AIR LIQUIDE SA	Grundstoffe	1,63%	Frankreich
S&P GLOBAL INC	Finanzen	1,61%	USA
EDP – ENERGIAS DE PORTUGAL SA	Versorgungsunternehmen	1,59%	Portugal
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	Finanzen	1,58%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

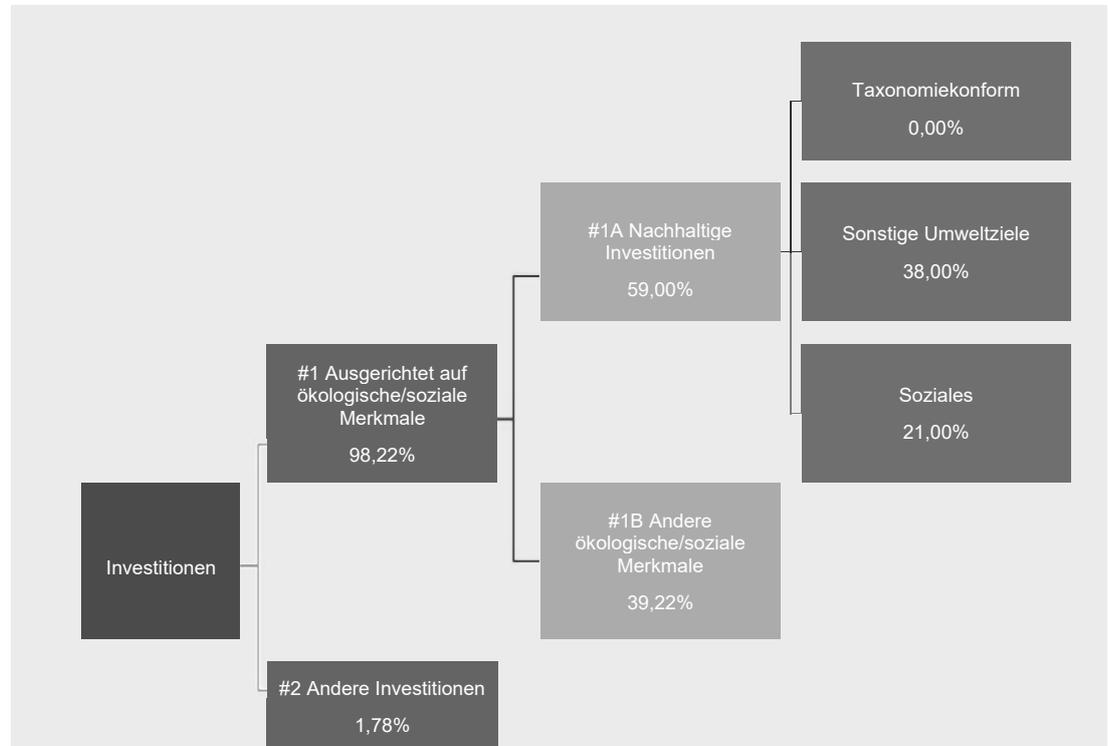
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 59,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,22 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,78 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 59,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Gesundheitssektor	20,17%
Informationstechnologie	18,86%
Finanzen	13,96%
Basiskonsumgüter	13,92%
Industrie	11,13%
Zyklische Konsumgüter	7,76%
Versorgungsunternehmen	4,60%
Kommunikationsdienste	4,16%
Grundstoffe	3,66%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Kapitalmärkte	8,98%
Software	7,61%
Ausrüstung und Zubehör für das Gesundheitswesen	7,39%
Stromversorger	4,60%
Biowissenschaftliche Hilfsmittel und Dienstleistungen	4,59%
Lebensmittel- und Basiskonsumgütereinzelhandel	4,22%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,07%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	3,55%
Versicherungen	3,39%
Pharmazie	3,30%
Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	2,91%
Überlandtransport	2,88%
Chemische Erzeugnisse	2,85%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	2,69%
Biotechnologie	2,61%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar 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 Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

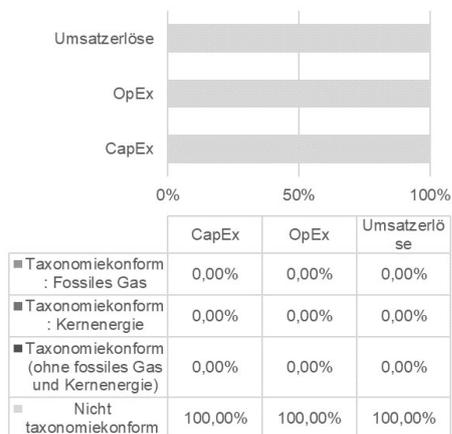
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

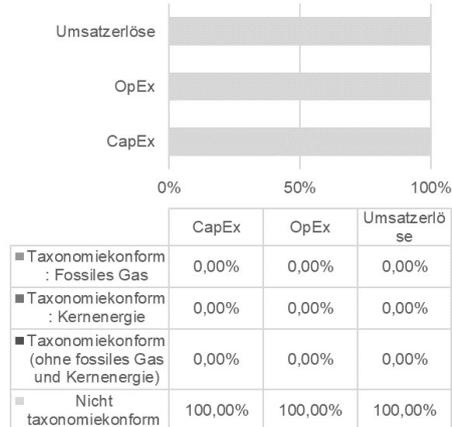
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



● **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 38,00 %.



● **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 21,00 %.



● **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,78 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



● **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening guter Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

AAA: 38%

AA: 44%

A: 18%

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 hier: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

3. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

4. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



● **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?**

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder

Nicht zutreffend

sozialen Merkmale
erreicht.



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57,35% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren umfasst ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Zu diesen identifizierten ESG-Merkmalen gehören:

- Ökologische Faktoren, wie die Anlagepraxis eines Unternehmens, Treibhausgas- (THG) Emissionen und Klimaschutzmaßnahmen, Dekarbonisierungspläne und Investitionen, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft unterstützen.
- Soziale Faktoren, wie den Ansatz eines Unternehmens zu kommunalen Beziehungen, Sicherheit und Gesundheit am Arbeitsplatz und ein fairer Zugang zu wesentlichen Dienstleistungen.

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?**

Die Nachhaltigkeitsindikatoren für die Messung der Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale waren:

- Der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, betrug 57 % und
- das ESG-Rating des Fonds (7,31) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,45), 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 „Fonds ESG-Rating“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums unter Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft. Das „investierbare Anlageuniversum“ des Fonds besteht aus 200 Aktien aus dem Infrastrukturbereich, die zusammen als RARE200 bezeichnet werden. Diese werden im Rahmen des Anlageprozesses vierteljährlich überprüft.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,31
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,45

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds für Investitionen in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitragen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassten:

- Stromversorgungsunternehmen, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern (32 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (38 %)
- Wasserversorger, welche die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem der Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleistet wird (18 %)
- Kommunikationsinfrastruktur, mit der eine Transportalternative angeboten wird und deren soziale Auswirkungen, indem der Zugang zu wesentlichen Diensten gewährleistet wird (12 %).

All dies wurde zunächst dadurch bewertet, indem der jeweilige Beitrag zu einem der beiden folgenden Punkte berücksichtigt wurde:

- SDG-Ausrichtung von Produkten und Dienstleistungen (45 % des Portfolios)
- THG-Intensität und Reduzierungsziele von Emissionen im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Drittanbieter und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (48 % des Portfolios)

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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.

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilsektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihrer Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist. In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Er wird von spezifischen EU-Kriterien begleitet. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, 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.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investiert/e nicht in Unternehmen, die Umsätze aus (a) ausgeschlossenen Waffen generieren, gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	319 510,77	92,41%
CO ₂ -Bilanz (USD)	313,64	92,41%
THG-Intensität (USD)	2 125,77	95,98%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	43,82%	92,41%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	92,41%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,98%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	37,37%	92,41%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	92,41%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
NEXTERA ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	4,63%	USA
GETLINK SE	Industrie	3,81%	Frankreich
AMERICAN TOWER CORP	Immobilien	3,78%	USA
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	Versorgungsunternehmen	3,59%	USA
EAST JAPAN RAILWAY CO	Industrie	3,55%	Japan
SSE PLC	Versorgungsunternehmen	3,46%	Vereinigtes Königreich
CHENIERE ENERGY INC	Energie	3,14%	USA
ENBRIDGE INC	Energie	3,13%	Kanada
TRANSURBAN GROUP	Industrie	3,07%	Australien
IBERDROLA SA	Versorgungsunternehmen	2,99%	Spanien
CONSTELLATION ENERGY CORP	Versorgungsunternehmen	2,92%	USA
PEMBINA PIPELINE CORP	Energie	2,89%	Kanada
CELLNEX TELECOM SA	Kommunikationsdienste	2,87%	Spanien
UNION PACIFIC CORP	Industrie	2,87%	USA
FERROVIAL SA	Industrie	2,85%	Spanien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

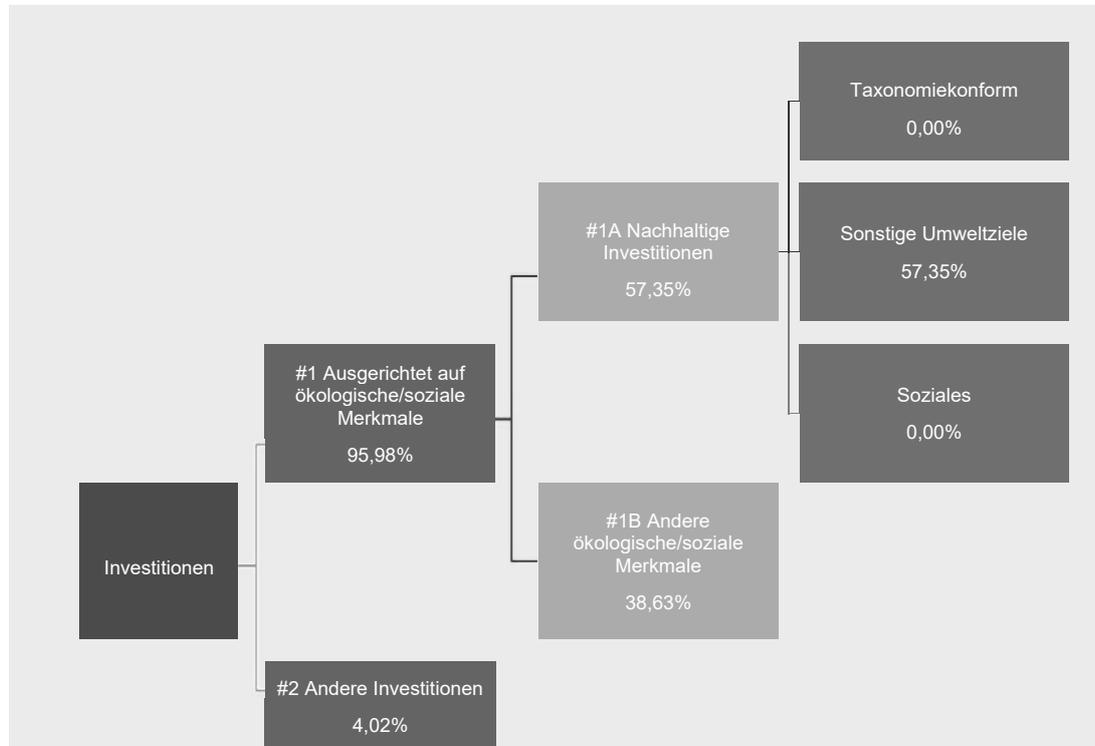
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 57,35 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,98 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (4,02 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 57,35 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Versorgungsunternehmen	51,68%
Industrie	24,64%
Energie	13,18%
immobilien	3,73%
Kommunikationsdienste	2,75%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Stromversorger	36,83%
Öl, Gas und nicht-erneuerbare Brennstoffe	13,18%
Überlandtransport	11,44%
Wasserversorger	9,85%
Verkehrsinfrastruktur	9,02%
Bau- & Ingenieurwesen	4,18%
Aktien-Immobilienfonds	3,73%
Multi-Versorger	3,12%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,75%
Gasversorger	1,87%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

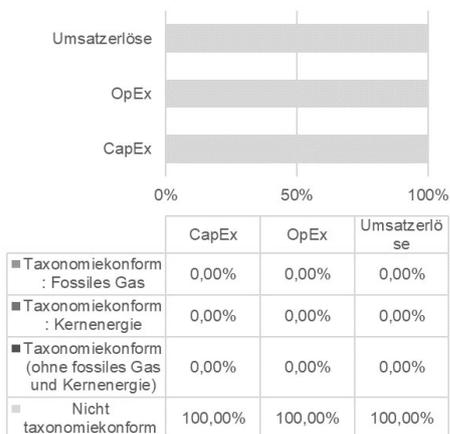
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

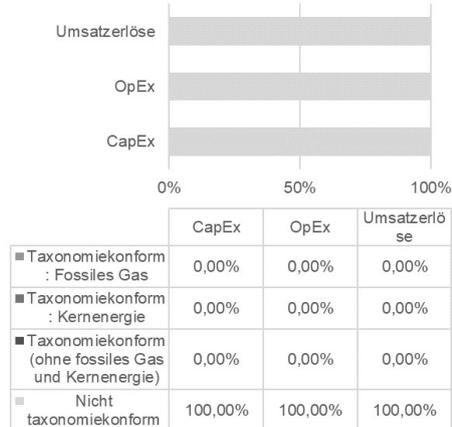
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 57,35 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 4,02 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung wendete den ESG-Prozess einheitlich an. Er wird in alle Schlüsselemente des Anlageprozesses einbezogen und berücksichtigt.

Dies umfasste:

- Negative Screenings bei der Konstruktion des investierbaren Anlageuniversums, um Grenzen bei der Förderung und der Produktion fossiler Brennstoffe, von Tabak, Waffen und UNGC-Verstößen zu beachten
- Anwendung ihres Drei-Säulen-Prozesses der ESG-Integration, nämlich:
 - Prognostizierte Cashflow-Anpassungen auf der Grundlage von ESG-Faktoren
 - Erforderliche Renditeanpassung auf der Basis des ESG-Risikos, wie anhand der eigenen Scorecard des Anlageverwalters beurteilt (siehe unten)
 - Engagement, darunter die Beobachtung von Kontroversen
- Andere ESG-Analysen und -Prozesse, darunter unter anderem Nachhaltigkeitsprüfungen der ESG-Scorecards von Unternehmen, die Analyse des Energiemixes und der Dekarbonisierungspläne, PAI-Überlegungen und so weiter.

Einige der oben genannten Tätigkeiten werden unten mit den jeweiligen Ergebnissen näher beschrieben.

2. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet werden. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

- AAA: 25%
- AA: 60%
- A: 15%
- 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: 48%
- Soziales: 22%
- Governance: 30%

4. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Clearbridge Global Infrastructure Income Fund



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 Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 35,52% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte eine positive Wirkung im Hinblick auf:

- Eindämmung des Klimawandels,
- Anpassung an den Klimawandel, und/oder
- soziale Wirksamkeit.

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 Transport auf der Schiene statt Alternativen per Flugzeug oder auf der Straße,
- Investitionen in Infrastruktur, die die Anpassung an den Klimawandel unterstützen,
- Infrastruktur, die soziale Wirksamkeit unterstützt, wie die Bereitstellung eines fairen Zugangs zu grundlegenden Dienstleistungen wie Zugang zu Wasser, Energie und Kommunikation, und
- Einhaltung der Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC).

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete der Anlageverwalter einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Dieses firmeneigene Verfahren umfasst ein ESG-Ratingsystem, das eine Wesentlichkeitskarte benutzt, um spezifische ESG-Merkmale zu identifizieren, die das Investment betreffen.

Die Anlageverwaltung wendet ihren ESG-Prozess auf alle Anlagen im Berichtszeitraum an. Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 15 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Die Nachhaltigkeitsindikatoren für die Messung der Erreichung jedes der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale waren:

- Der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, betrug 35,5 % und
- das ESG-Rating des Fonds (7,89) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,58), wie in der Tabelle unten ersichtlich.

Dort, wo die ESG-Punktzahlen auf MSCI-Daten beruhen, sind sie gleichgewichtet mit dem „ESG-Rating des Anlageuniversums“ und der Portfoliogewichtung für das „Fonds ESG-Rating“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums bei Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,89
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,58

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds zur Investition in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitragen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassten:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbarer Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern (60 %)
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert (24 %)
- Wasserversorger, welche die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem der Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleistet wird (15 %)

All dies wurde zunächst dadurch bewertet, indem der jeweilige Beitrag zu einem der beiden folgenden Punkte berücksichtigt wurde:

- SDG-Ausrichtung von Produkten und Dienstleistungen (36,5 % des Portfolios)
- THG-Intensität und Reduzierungsziele von Emissionen im Rahmen der Wirtschaftsaktivitäten eines Unternehmens, beurteilt von einem Drittanbieter und mit einem verifizierten Dekarbonisierungsziel, das auf das Pariser Abkommen ausgerichtet ist (34,4 % des Portfolios)

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Engagement-Prozess, um die Best-in-Class-Wertpapiere zu identifizieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der eigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilsektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

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.

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 Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI 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 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihrer Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UN Global Compact und die OECD-Leitsätze)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investiert/e nicht in Unternehmen, die Umsätze aus (a) ausgeschlossenen Waffen generieren, gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.

Stand der unten genannten Metrik nachteiliger Auswirkungen: 31. Dezember 2022.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (USD)	139 114,60	96,67%
CO ₂ -Bilanz (USD)	351,77	96,67%
THG-Intensität (USD)	2 500,32	98,02%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	61,11%	94,59%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	94,59%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,02%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	37,07%	94,59%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	94,59%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
IBERDROLA SA	Versorgungsunternehmen	4,72%	Spanien
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	Versorgungsunternehmen	4,36%	USA
NATIONAL GRID PLC	Versorgungsunternehmen	4,34%	Vereinigtes Königreich
SSE PLC	Versorgungsunternehmen	4,28%	Vereinigtes Königreich
EDP – ENERGIAS DE PORTUGAL SA	Versorgungsunternehmen	3,98%	Portugal
APA GROUP	Versorgungsunternehmen	3,77%	Australien
SNAM SPA	Versorgungsunternehmen	3,49%	Italien
PEMBINA PIPELINE CORP	Energie	3,43%	Kanada
ENBRIDGE INC	Energie	3,35%	Kanada
ENERGY CORP	Versorgungsunternehmen	3,26%	USA
ATLAS ARTERIA	Industrie	3,23%	Australien
NEXTERA ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	3,22%	USA
TRANSURBAN GROUP	Industrie	3,10%	Australien
CLEARWAY ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	2,98%	USA
CROWN CASTLE INC	Immobilien	2,95%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

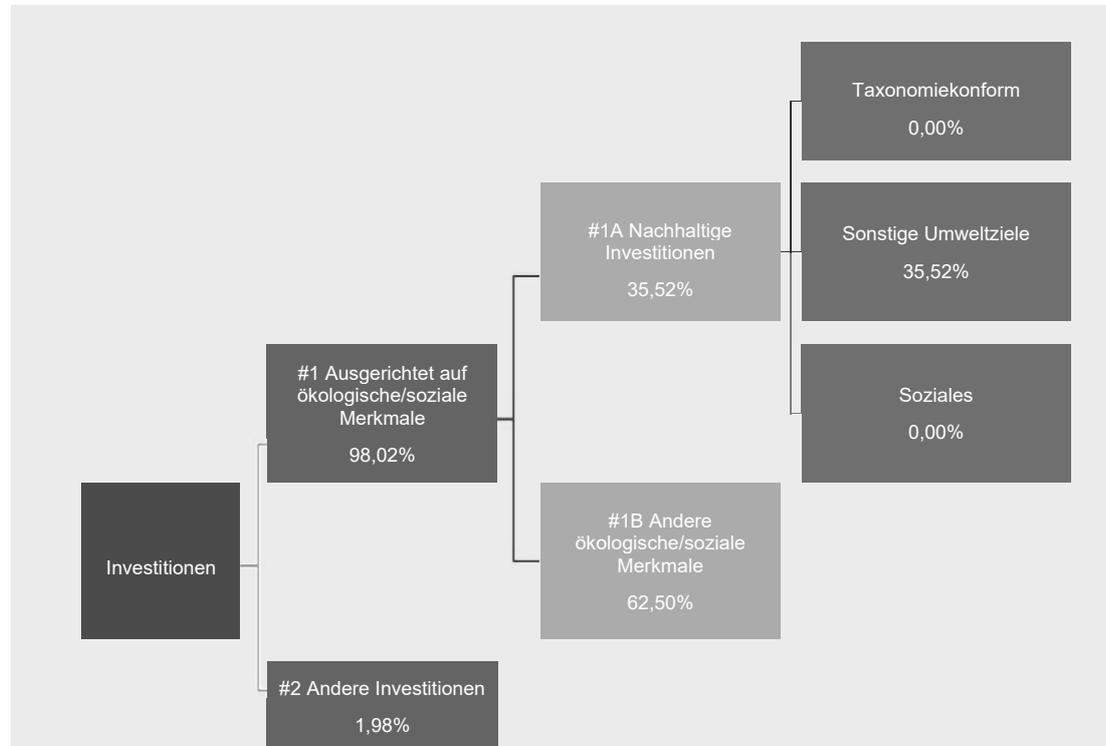
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 35,52 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,02 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (<1,98 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestanden aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 35,52 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Versorgungsunternehmen	66,99%
Energie	15,36%
Industrie	12,93%
immobilien	2,75%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Stromversorger	32,55%
Öl, Gas und nicht-erneuerbare Brennstoffe	15,36%
Gasversorger	13,56%
Multi-Versorger	8,82%
Verkehrsinfrastruktur	7,68%
Unabhängige Strom- und erneuerbare Elektrizitätsproduzenten	6,04%
Wasserversorger	6,03%
Überlandtransport	3,10%
Aktien-Immobilienfonds	2,75%
Bau- & Ingenieurwesen	2,14%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

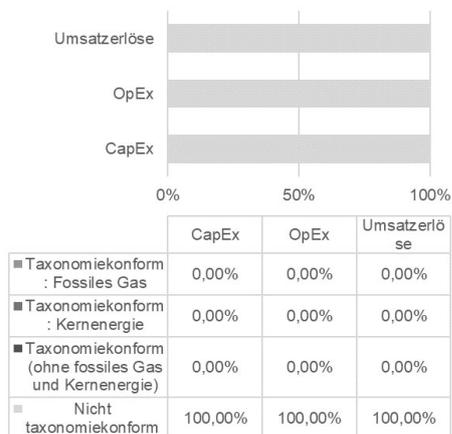
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

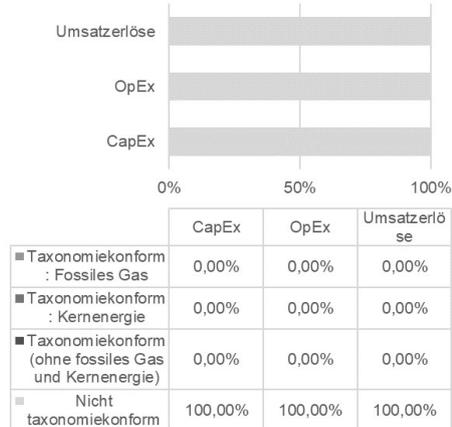
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichten Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten, wie sie in Artikel 16 und Artikel 10(2) der Taxonomie-Verordnung der EU definiert sind.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 35,52 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,98 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung wendete den ESG-Prozess einheitlich an. Er wird in alle Schlüsselemente des Anlageprozesses einbezogen und berücksichtigt.

Dies umfasste:

- Negative Screenings bei der Konstruktion des investierbaren Anlageuniversums, um Grenzen bei der Förderung und der Produktion fossiler Brennstoffe, von Tabak, Waffen und UNGC-Verstößen zu beachten
- Anwendung ihres Drei-Säulen-Prozesses der ESG-Integration, nämlich:
 - Prognostizierte Cashflow-Anpassungen auf der Grundlage von ESG-Faktoren
 - Erforderliche Renditeanpassung auf der Basis des ESG-Risikos, wie anhand der eigenen Scorecard des Anlageverwalters beurteilt (siehe unten)
 - Engagement, darunter die Beobachtung von Kontroversen
- Andere ESG-Analysen und -Prozesse, darunter unter anderem Nachhaltigkeitsprüfungen der ESG-Scorecards von Unternehmen, die Analyse des Energiemixes und der Dekarbonisierungspläne, PAI-Überlegungen und so weiter.

Einige der oben genannten Tätigkeiten werden unten mit den jeweiligen Ergebnissen näher beschrieben.

2. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B, die Unternehmen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet werden. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Rating-Verteilung für diesen Fonds sah zum 31.12.2022 wie folgt aus:

- AAA: 11%
- AA: 73%
- A: 16%
- B: 0%

3. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement der Anlageverwaltung hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Die Einzelheiten zum Engagement des Fonds im Referenzzeitraum waren wie folgt:

- Umwelt: 48%
- Soziales: 22%
- Governance: 30%

4. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300E56Y0Z3ZFW4W35

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 73,90% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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 biologische Vielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 73,9 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Zeitraums waren 5 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 24 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Referenzzeitraums intervenierte das Management-Team 25 Mal zu ESG-Themen – entweder zur Information oder mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands, die Pläne der Unternehmen zur Verringerung von THG-Emissionen sowie Förderung einer besseren Offenlegung durch die Unternehmen abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO2-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO2-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	0,00%
2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	11,00%
3. Diskussion über die Probleme findet statt	44,00%
4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	44,00%
5. Unternehmen greift das Thema auf	0,00%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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. Zum 31. Dezember 2022 betrug nachhaltige Anlagen 82,10 % des Fonds, lagen also über der Minimalanforderung von 50 %.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

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.

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO2-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtspolitik.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	4 751,00	96,54%
CO2-Bilanz (EUR)	347,32	96,54%
THG-Intensität (EUR)	675,20	96,54%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	6,71%	96,54%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	97,76%	87,82%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	0,00	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	0,45	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	0,00	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	4,70	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,00	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,00	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	0,07	90,34%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,00	90,34%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	96,54%
Emissionen in Wasser (EUR)	0,09	9,88%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,70	45,28%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,19%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	71,01%	96,54%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	24,97%	6,43%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	20,50%	96,54%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	96,54%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	6,67%	Taiwan
HDFC BANK LTD	Finanzen	5,56%	Indien
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienste	5,48%	China
AIA GROUP LTD	Finanzen	5,14%	Hongkong
UNITED OVERSEAS BANK LTD	Finanzen	5,04%	Singapur
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Zyklische Konsumgüter	4,20%	China
HERO MOTOCORP LTD	Zyklische Konsumgüter	3,84%	Indien
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	Versorgungsunternehmen	3,76%	China
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING LTD	Industrie	3,70%	Singapur
VENTURE CORP LTD	Informationstechnologie	3,65%	Singapur
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD	Kommunikationsdienste	3,62%	Singapur
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD	Gesundheitssektor	3,46%	China
TATA CONSULTANCY SERVICES LTD	Informationstechnologie	3,18%	Indien
JARDINE MATHESON HOLDINGS LTD	Industrie	2,95%	Hongkong
MINTH GROUP LTD	Zyklische Konsumgüter	2,74%	China



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

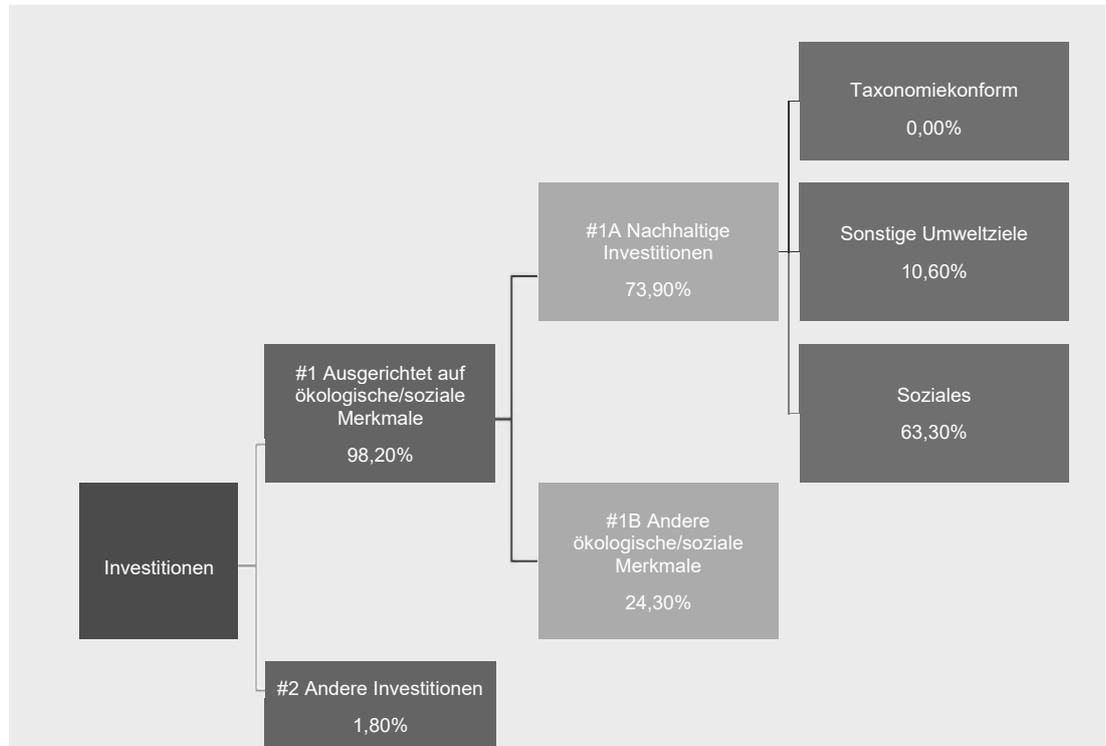
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 73,90 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,20 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,80 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 73,90 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Zyklische Konsumgüter	21,13%
Informationstechnologie	19,85%
Finanzen	18,96%
Kommunikationsdienste	12,81%
Industrie	7,74%
Versorgungsunternehmen	6,08%
Grundstoffe	5,08%
Gesundheitssektor	4,89%
Basiskonsumgüter	1,66%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	10,72%
Versicherungen	8,24%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	7,06%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	6,92%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	6,43%
Interaktive Medien und Dienstleistungen	6,37%
Chemische Erzeugnisse	5,08%
IT-Dienstleistungen	4,97%
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter	4,85%
Automobilindustrie	3,95%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	3,84%
Gasversorger	3,55%
Raumfahrt und Verteidigung	3,54%
Pharmazie	3,44%
Fahrzeugkomponenten	2,91%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

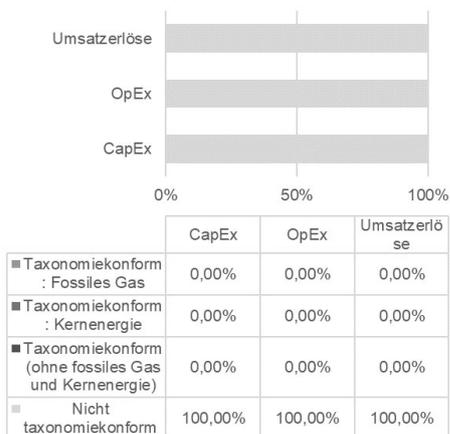
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

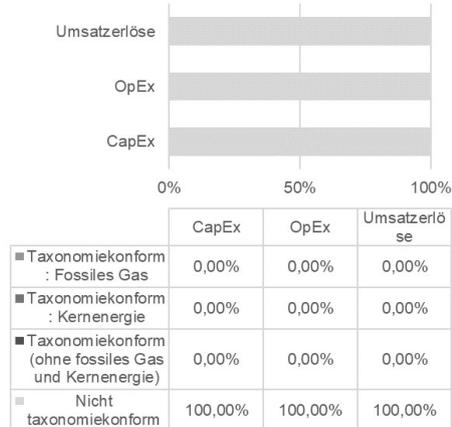
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 10,60 %.

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 63,30 %.

- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,80 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, Tabakproduktion, umstrittene Waffen und die Gewinnung fossiler Brennstoffe.
- 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.



- **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



Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493007B7CQP4E08O434

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 88,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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 biologische Vielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 88 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Zeitraums waren 60 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 7 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Zeitraums intervenierte das Management-Team fünfmal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands, die Pläne der Unternehmen zur Verringerung von CO₂-Emissionen sowie Menschenrechte abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO₂-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO₂-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	40,00%
2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	0,00%
3. Diskussion zu den Problemen findet statt	0,00%
4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	40,00%
5. Unternehmen greift das Thema auf	20,00%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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. Zum 31. Dezember 2022 betrug nachhaltige Anlagen 88 % des Fonds, lagen also über der Minimalanforderung von 50 %.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen haben. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

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.

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtspolitik.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	8 716,25	99,49%
CO2-Bilanz (EUR)	67,27	99,49%
THG-Intensität (EUR)	431,12	99,49%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	0,00%	99,49%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	65,03%	85,02%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	0,34	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,02	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	0,00	93,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,00	93,86%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	99,49%
Emissionen in Wasser (EUR)	1,01	10,62%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,06	36,29%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	99,49%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	52,33%	99,12%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	11,75%	20,44%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	32,86%	99,49%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	99,49%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	5,80%	USA
LINDE PLC	Grundstoffe	5,15%	Vereinigtes Königreich
RESMED INC	Gesundheitssektor	4,87%	USA
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	4,73%	USA
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	4,29%	Frankreich
ASML HOLDING NV	Informationstechnologie	4,12%	Niederlande
MASTERCARD INC	Informationstechnologie	4,10%	USA
KINGSPAN GROUP PLC	Industrie	4,09%	Irland
ATLAS COPCO AB	Industrie	3,98%	Schweden
MONCLER SPA	Zyklische Konsumgüter	3,84%	Italien
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	Gesundheitssektor	3,76%	China
FERRARI NV	Zyklische Konsumgüter	3,61%	Italien
CSL LTD	Gesundheitssektor	3,57%	Australien
HEXAGON AB	Informationstechnologie	3,56%	Schweden
COLOPLAST A/S	Gesundheitssektor	3,46%	Dänemark



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

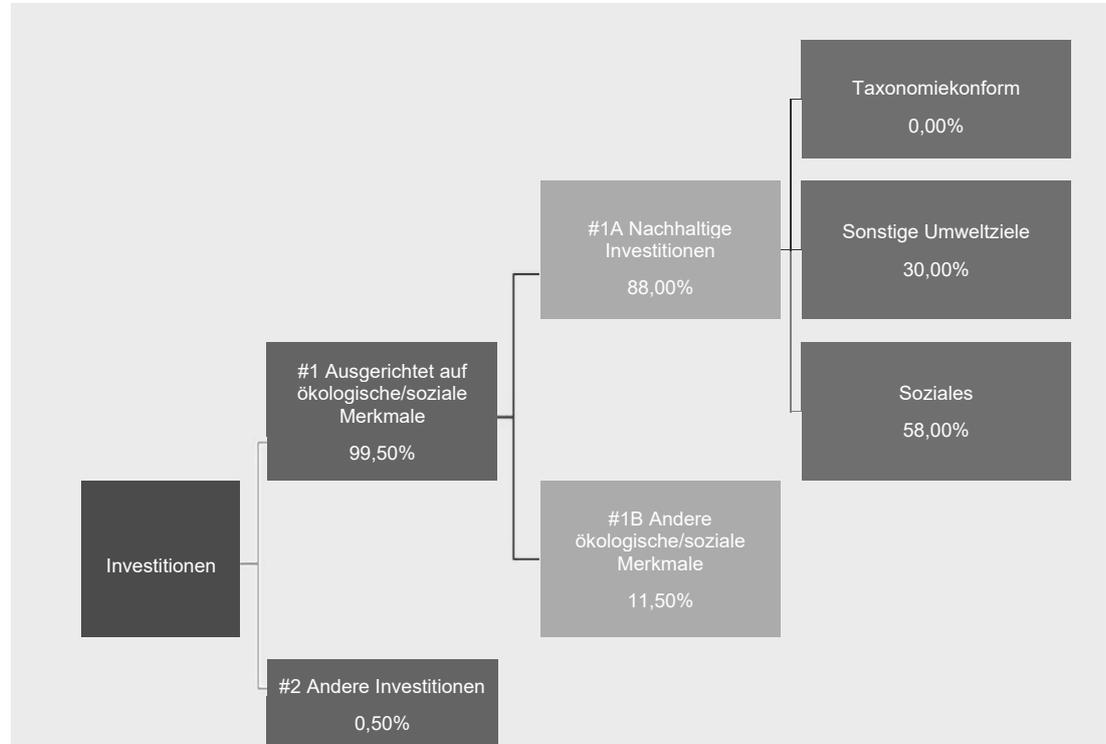
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 88,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,50 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,50 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 88,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	30,33%
Gesundheitssektor	26,33%
Zyklische Konsumgüter	14,51%
Industrie	10,53%
Grundstoffe	7,70%
Basiskonsumgüter	6,56%
Finanzen	3,53%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Software	13,14%
Ausrüstung und Zubehör für das Gesundheitswesen	11,37%
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter	10,70%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	9,67%
Chemische Erzeugnisse	7,70%
Baustoffe	6,31%
Biowissenschaftliche Hilfsmittel und Dienstleistungen	5,86%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,29%
IT-Dienstleistungen	4,24%
Maschinen	4,23%
Automobilindustrie	3,81%
Biotechnologie	3,55%
Versicherungen	3,53%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	3,28%
Pharmazie	2,94%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsschwere aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

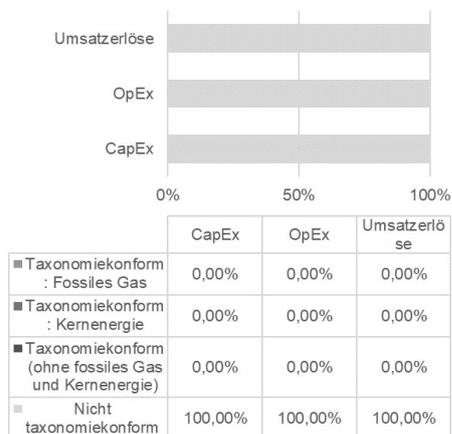
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

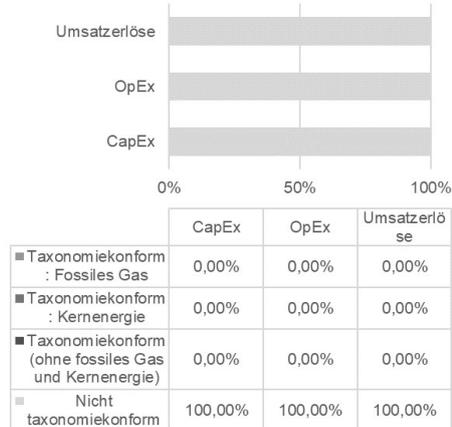
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 30,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 58,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 0,50 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle anderen ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend

FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund



FRANKLIN TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300REHT50ARB1IW32

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 80,40% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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 biologische Vielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 80,40 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Zeitraums waren 12 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte 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 Zeitraums intervenierte das Management-Team achtmal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands und die Pläne der Unternehmen im Hinblick auf den Übergang zu Netto Null CO₂-Emissionen abgedeckt.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO₂-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO₂-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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. Zum 31. Dezember 2022 betrug nachhaltige Anlagen 80 % des Fonds, lagen also über der Minimalanforderung von 50 %.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtspolitik.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

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 der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	19 032,27	88,06%
CO2-Bilanz (EUR)	854,37	88,06%
THG-Intensität (EUR)	1 411,15	88,06%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	15,95%	88,06%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	81,00%	80,36%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	0,01	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	8,92	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	4,70	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,05	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,00	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	1,06	86,78%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,24	86,78%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	88,06%
Emissionen in Wasser (EUR)	0,00	0,00%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,34	28,29%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	95,90%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	56,51%	84,70%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	17,86%	2,48%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	28,83%	88,06%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	88,06%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
EMBASSY OFFICE PARKS REIT	Immobilien	5,04%	Indien
TRANSURBAN GROUP	Industrie	5,02%	Australien
LINK REIT	Immobilien	4,90%	Hongkong
GUANGDONG INVESTMENT LTD	Versorgungsunternehmen	4,82%	China
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	Versorgungsunternehmen	4,56%	Indien
NHPC LTD	Versorgungsunternehmen	4,48%	Indien
CHARTER HALL RETAIL REIT	Immobilien	4,30%	Australien
SCENTRE GROUP	Immobilien	3,96%	Australien
CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST	Immobilien	3,87%	Singapur
DIGITAL TELECOMMUNICATIONS INFRASTRUCTURE FUND	Immobilien	3,61%	Thailand
VICINITY LTD	Immobilien	3,59%	Australien
AURIZON HOLDINGS LTD	Industrie	3,36%	Australien
AGL ENERGY LTD	Versorgungsunternehmen	3,25%	Australien
CLP HOLDINGS LTD	Versorgungsunternehmen	3,20%	Hongkong
FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	Immobilien	3,04%	Hongkong



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

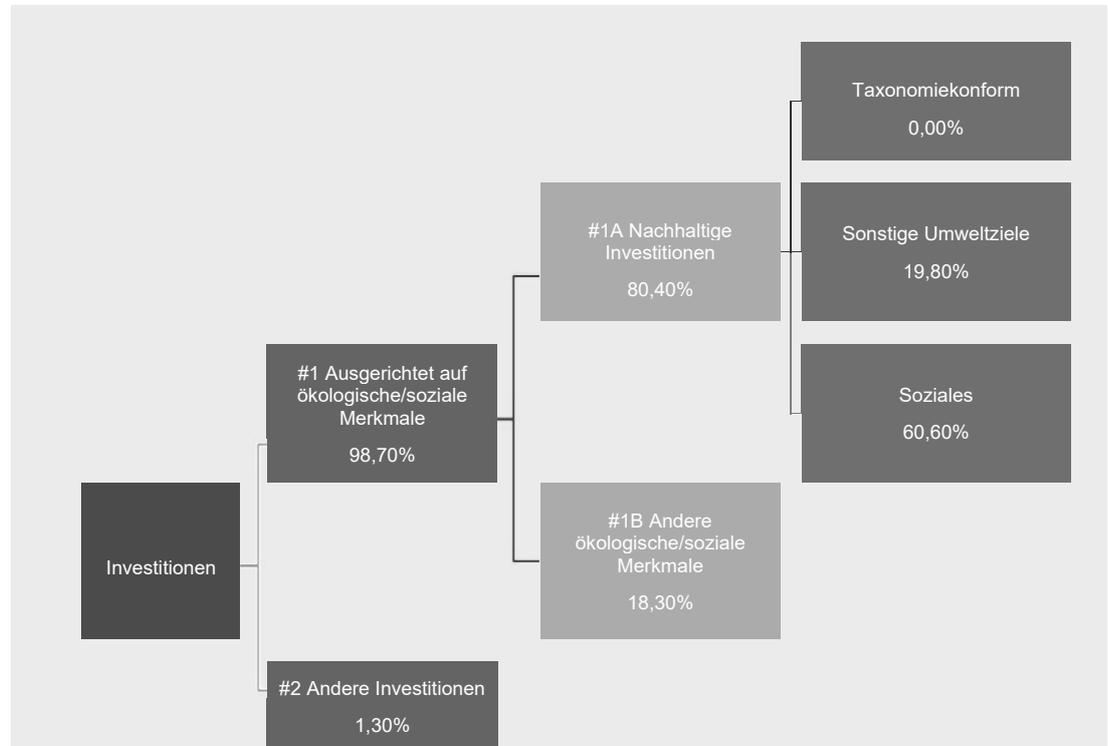
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 80,40 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,70 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,30 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 80,40 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
immobilien	48,80%
Versorgungsunternehmen	27,72%
Industrie	15,82%
Kommunikationsdienste	6,68%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Aktien-Immobilienfonds	41,45%
Stromversorger	12,91%
Verkehrsinfrastruktur	12,45%
Immobilienverwaltung und -entwicklung	7,30%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	6,68%
Wasserversorger	5,35%
Überlandtransport	3,37%
Multi-Versorger	3,36%
Unabhängige Strom- und erneuerbare Elektrizitätsproduzenten	3,11%
Gasversorger	2,99%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar 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 Treibhausgasemissionsschwerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

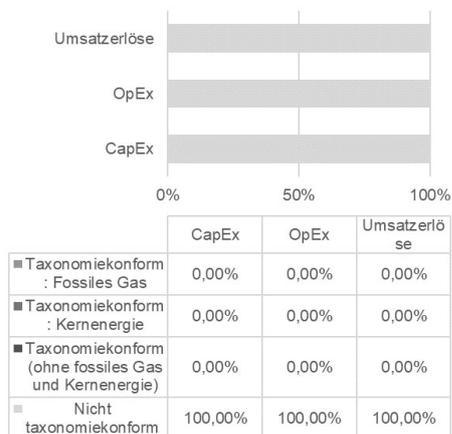
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

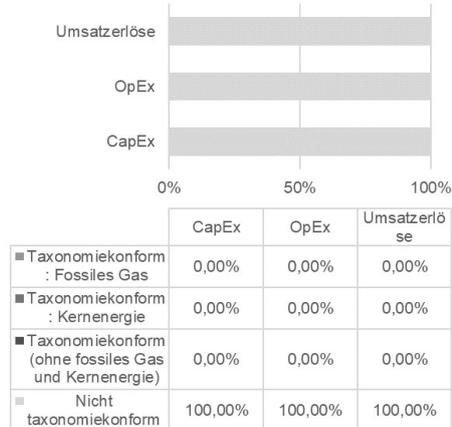
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 19,80 %.

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 60,60 %.

- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,30 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und andere ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.



- **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



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 73,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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 biologische Vielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 73 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Zeitraums waren 4 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 20 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre Ziele zu setzen.

Im Laufe des Zeitraums intervenierte das Management-Team 52 Mal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands, die Pläne der Unternehmen zum Übergang auf Netto-Null CO₂-Emissionen sowie die Unternehmenskultur abgedeckt. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen:

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO₂-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO₂-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
1. Unternehmen zu den Problemen kontaktieren	4,00%
2. Unternehmen bestätigt den Kontakt	12,00%
3. Diskussion zu den Problemen findet statt	58,00%
4. Unternehmen legt Plan zur Behebung des Problems vor	19,00%
5. Unternehmen greift das Thema auf	8,00%

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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. Zum 31. Dezember 2022 betrug nachhaltige Anlagen 73 % des Fonds, lagen also über der Minimalanforderung von 50 %.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltige Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen haben. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

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.

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtspolitik.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	11 085,00	96,39%
CO2-Bilanz (EUR)	329,97	96,39%
THG-Intensität (EUR)	1 004,71	96,39%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	7,95%	96,39%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	86,15%	81,90%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	1,47	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	3,01	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,22	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	0,07	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,00	87,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	96,39%
Emissionen in Wasser (EUR)	0,02	14,67%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,45	50,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	96,68%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	74,61%	95,98%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	25,65%	9,73%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	18,30%	96,39%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	96,39%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der** im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	8,46%	Taiwan
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Informationstechnologie	7,60%	Südkorea
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienste	6,42%	China
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Zyklische Konsumgüter	3,82%	China
ICICI BANK LTD	Finanzen	3,60%	Indien
RELIANCE INDUSTRIES LTD	Energie	3,09%	Indien
SK HYNIX INC	Informationstechnologie	2,87%	Südkorea
AIA GROUP LTD	Finanzen	2,76%	Hongkong
TITAN CO LTD	Zyklische Konsumgüter	2,72%	Indien
MEITUAN	Zyklische Konsumgüter	2,71%	China
HDFC BANK LTD	Finanzen	2,45%	Indien
BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT	Finanzen	2,33%	Indonesien
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	Finanzen	2,22%	China
AL RAJHI BANK	Finanzen	2,10%	Saudi-Arabien
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	Industrie	2,08%	China



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

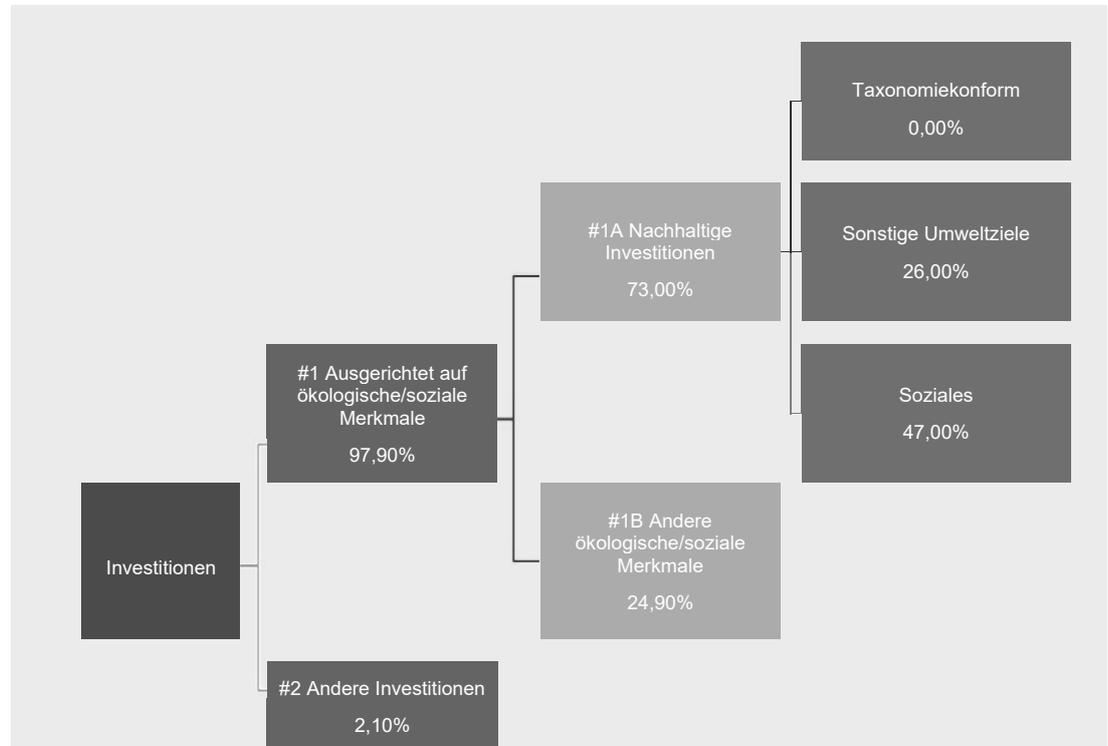
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 73,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,90 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,10 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 73,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	26,33%
Informationstechnologie	25,33%
Zyklische Konsumgüter	13,38%
Kommunikationsdienste	8,77%
Grundstoffe	7,10%
Industrie	5,47%
Energie	4,79%
Gesundheitssektor	3,00%
Basiskonsumgüter	2,51%
Versorgungsunternehmen	1,21%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	19,35%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	12,70%
Internet- und Direktmarketing-Einzelhandel	8,22%
Technologie-Hardware, Speicher und Peripheriegeräte	7,38%
Interaktive Medien und Dienstleistungen	7,31%
Versicherungen	5,40%
Öl, Gas und nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,79%
Elektronikgeräte	4,16%
Chemische Erzeugnisse	3,93%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	2,76%
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter	2,56%
IT-Dienstleistungen	2,50%
Metalle und Bergbau	2,11%
Lebensmittel- und Basiskonsumgütereinzelhandel	2,04%
Automobilindustrie	1,70%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

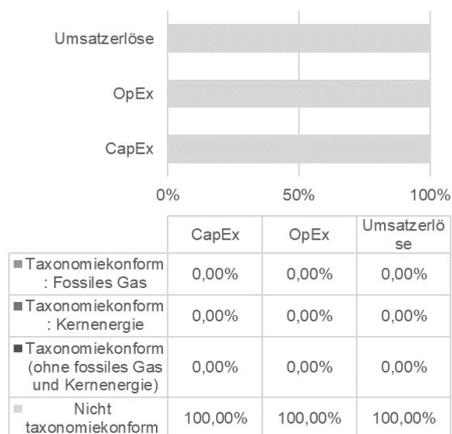
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

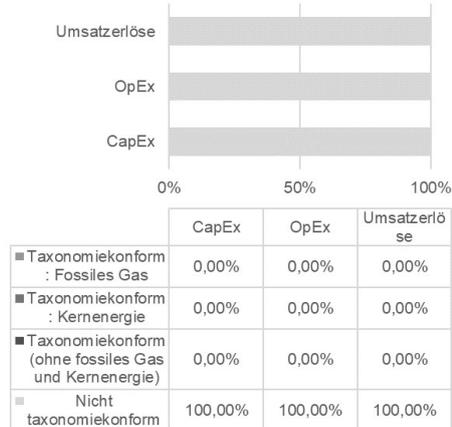
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

- **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

- **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betragen Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 26,00 %.

- **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 47,00 %.

- **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 2,10 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



- **Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?**

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Tabak, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und Kohle.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.



- **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



Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493001JP7YZEMZJTE31

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt. Dabei wird vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 76,00% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

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 biologische Vielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in kontroversen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Wie im eigenen Rahmen des Anlageverwalters auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden am Ende des Referenzzeitraums 76 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Zeitraums waren 64 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftlich fundierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets Initiative genehmigt hatten, und weitere 9 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Jahresverlauf intervenierte das Management-Team 26 Mal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Zusammensetzung des Vorstands und die Pläne der Unternehmen zum Übergang auf Netto-Null CO₂-Emissionen abgedeckt.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO₂-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO₂-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

● **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

● **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. Zum 31. Dezember 2022 betrug nachhaltige Anlagen 76 % des Fonds, lagen also über der Minimalanforderung von 50 %.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch den Anlageverwalter unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung von DNSH in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einer hohen und nicht kontrollierten CO₂-Bilanz in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte der Anlageverwalter auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete der Anlageverwalter die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren und zwei zusätzliche Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtspolitik.

Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo der Anlageverwalter potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

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 der Anlageverwalter diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse des Anlageverwalters, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und der Anlageverwalter legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung des Anlageverwalters effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und der Anlageverwalter erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgas- (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Der Anlageverwalter berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat der Anlageverwalter mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik des Anlageverwalters ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete der Anlageverwalter auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung des Anlageverwalters für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 obligatorischen PAI und der beiden zusätzlichen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Der Anlageverwalter beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Bilanz) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Sektor der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil der genutzten erzeugten Energie aus nicht erneuerbaren Quellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Verbindung zu umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik des Anlageverwalters in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die mit kontroversen Waffen in Verbindung stehen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie des Anlageverwalters für verantwortliches Investieren.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	12 594,31	96,22%
CO2-Bilanz (EUR)	71,95	96,22%
THG-Intensität (EUR)	416,67	96,22%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	0,00%	96,22%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	70,31%	82,33%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	0,31	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,02	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	0,00	93,16%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,00	93,16%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	96,22%
Emissionen in Wasser (EUR)	0,01	5,04%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,09	47,76%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	98,99%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Richtlinien der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Konzerne.	50,36%	95,15%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	19,03%	11,63%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	35,94%	96,22%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	96,22%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die Hauptinvestitionen dieses Fonds bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2022-01-01 - 2022-12-31.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
ASML HOLDING NV	Informationstechnologie	9,13%	Niederlande
FERRARI NV	Zyklische Konsumgüter	8,29%	Italien
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	Gesundheitssektor	6,35%	USA
KERING SA	Zyklische Konsumgüter	5,04%	Frankreich
MONCLER SPA	Zyklische Konsumgüter	5,03%	Italien
LINDE PLC	Grundstoffe	4,98%	Vereinigtes Königreich
HEXAGON AB	Informationstechnologie	4,96%	Schweden
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	Gesundheitssektor	4,91%	Frankreich
L'OREAL SA	Basiskonsumgüter	4,84%	Frankreich
ASSA ABLOY AB	Industrie	4,75%	Schweden
INFINEON TECHNOLOGIES AG	Informationstechnologie	4,39%	Deutschland
DASSAULT SYSTEMES SE	Informationstechnologie	4,29%	Frankreich
KINGSPAN GROUP PLC	Industrie	4,01%	Irland
PARTNERS GROUP HOLDING AG	Finanzen	3,53%	Schweiz
COLOPLAST A/S	Gesundheitssektor	3,53%	Dänemark



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

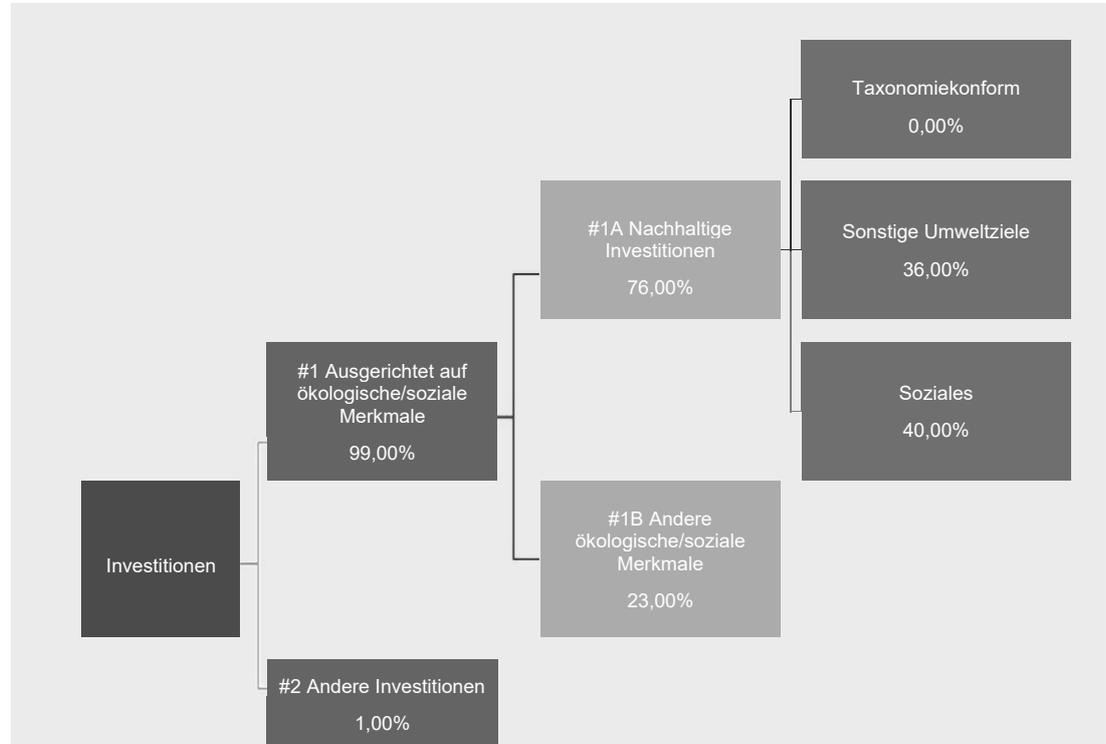
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 76,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,00 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,00 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vor allem aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 76,00 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Wichtigster Sektor	Anteil
Informationstechnologie	24,91%
Zyklische Konsumgüter	20,46%
Gesundheitssektor	19,19%
Industrie	13,19%
Basiskonsumgüter	7,95%
Grundstoffe	7,63%
Finanzen	5,66%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Biowissenschaftliche Hilfsmittel und Dienstleistungen	14,95%
Halbleiter und Halbleiteranlagen	13,07%
Textilien, Bekleidung und Luxusgüter	11,45%
Automobilindustrie	9,01%
Baustoffe	8,39%
Chemische Erzeugnisse	7,63%
Software	7,26%
Kapitalmärkte	5,66%
Produkte für den persönlichen Bedarf	4,94%
Maschinen	4,80%
Elektronikgeräte, -instrumente und -komponenten	4,58%
Ausrüstung und Zubehör für das Gesundheitswesen	4,24%
Lebensmittel	3,01%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

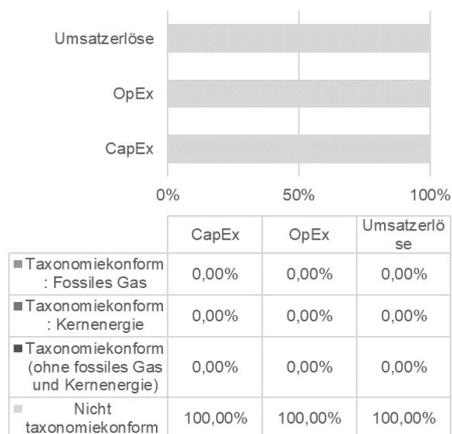
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

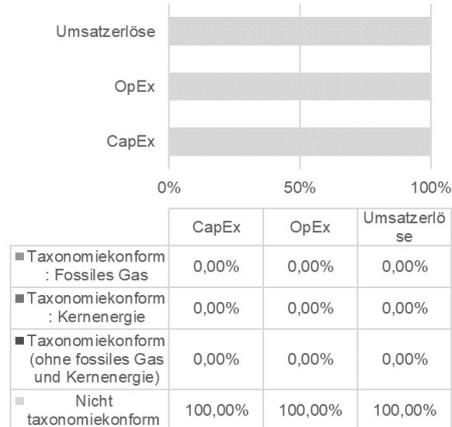
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einem ökologischen Ziel, das auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist. Dementsprechend betrug Ende Februar 2023 Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 36,00 %.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 40,00 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,00 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Engagement mit Portfoliounternehmen über das Festlegen oder die Implementierung von Zielen zur Verringerung von THG-Emissionen.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf eigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und alle anderen ausgeschlossene Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.



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 2028 Fund



FRANKLIN TEMPLETON

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 Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegtes Klassifikationssystem, das ein Verzeichnis **ökologisch nachhaltiger Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

JA

- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- Damit wurden **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

NEIN

- Damit wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 17,58% an nachhaltigen Investitionen
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- mit einem sozialen Ziel
- Damit wurden ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Da der Fonds am 23. Januar 2023 aufgelegt wurde und sich noch in der Kapitalbeschaffungs- und Kapitalverwendungsphase befindet, wurde die erstrebte Portfoliozusammensetzung noch nicht erreicht (und diese erste Phase kann bis zu 6 Monate dauern). Seit seiner Auflegung bewarb der Fonds ökologische und soziale Merkmale gemäß Artikel 8 der EU-Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (die „SFDR“). Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale umfassten:

- Förderung des Übergangs zu einer CO₂-armen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen, und
- im Rahmen seines Anlageprozesses Negativscreens anwendet,

Die beiden oben genannten Merkmale wurden erreicht.

Der Fonds investiert mindestens 11 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen. Der Fonds stellt sicher, dass seine nachhaltigen Investitionen ökologische oder soziale nachhaltige Anlageziele nicht erheblich beeinträchtigten. Mit Stand vom 28. Februar übertraf das Engagement des Fonds in grünen oder sozialen Anleihen 17,5 %. Mit Stand vom 28. Februar förderte der Fonds den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch Anwendung von c. 35 % der Vermögenswerte befinden sich in Emittenten, die nach der Klassifizierung der eigenen Methodik des Teams als „Champions“ zu bezeichnen sind. Weiterhin wurden ca. 26 % in Emittenten investiert, die als Outperformer klassifiziert wurden. Damit wurde mehr als die Hälfte der Vermögenswerte des Fonds in Emittenten angelegt, deren CO₂-Merkmale über denen des investierbaren Anlageuniversums liegen. Durch die Vermeidung von Anlagen in Wertpapieren, die mit schwerwiegenden Kontroversen assoziiert sind, oder bei denen ein Engagement in nachteiligen Wirtschaftsaktivitäten oberhalb von strengen Schwellenwerten vorliegt, sollte das Engagement des Fonds im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher nachteiliger Auswirkungen im Vergleich zu einer Benchmark möglichst niedrig liegen. Weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte den folgenden Abschnitten.

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?

Die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren wurden angewendet, um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewirbt:

A. Engagement in grünen, sozialen und Nachhaltigkeits- (GSS) Anleihen und solche, die von Umweltchampions begeben wurden.

– 12,98 % Anlagen in grünen Anleihen;

– 4,59 % Anlagen in sozialen Anleihen;

– 0 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen;

– 35 % Anlagen in Anleihen, die von Best-in-Class Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden.

Das Gesamtengagement in GSS-Anleihen und solchen, die von Umweltchampions begeben wurden, liegt bei 52 % des NIW. Das Engagement in grünen und sozialen Anleihen betrug exakt 17,58 % des NIW. Damit wurde die Verpflichtung zum verbindlichen Element der Anlagestrategie, mindestens 11 % des Fondsportfolios in nachhaltige Investitionen zu investieren, vollständig erfüllt.

B. Anwendung der ESG-Ausschlüsse.

Der prozentuale Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, wie in der Anlagestrategie beschrieben, beträgt 0 %. Der Ausschluss der untersten 20 % des Anlageuniversums basierend auf dem EETI und der ESG Credit App wurde sichergestellt. Mit Stand vom 28. Februar hält der Fonds lediglich eine Position, die man als „ein Nachzügler“ bezeichnen kann. Dieser Name wurde als investierbarer „Underperformer“ erworben, doch innerhalb des Anlagezeitraums verschlechterten sich seine Kohlenstoffmerkmale, und das Portfoliomanagement ist im Begriff, dieses Wertpapier innerhalb des von der Anlagestrategie vorgegebenen Zeitraums zu veräußern.

C. Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren).

Ein auf Fondsebene vierteljährlich gewichteter Durchschnitt aller berücksichtigten verpflichtenden PAI-Indikatoren wurde sowohl für den Fonds als auch für dessen Referenzindex berechnet. Der Fonds hat sich nicht dazu verpflichtet, auf Fondsebene einen PAI-Durchschnitt zu erzielen, der besser ist als der Benchmark-Durchschnitt.

D. Die Liste der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter zusammenarbeitet.

Mit den folgenden Emittenten fand im Referenzzeitraum eine Interaktion statt:

1. CEZ AS
2. International Business Machines Corp.
3. Italmatch Chemicals Spa
4. Morgan Stanley
5. Natwest Markets PLC

Diese 5 von 64 einmaligen Emittenten (8 %) bilden 9 % der Beteiligungen und repräsentieren 9,5 % des NIW des Fonds mit Stand vom 28. Februar 2023. Alle Interaktionen konzentrierten sich auf die Offenlegung von Daten und die Transparenz im Hinblick auf die ESG-Berichterstattung des Unternehmens (inkl. PAI-Indikatoren). Die übrigen mit den Emittenten diskutierten Themen waren unter anderem:

- Reduzierung von THG-Emissionen (80 % der Engagements),
- UNGC-Compliance (60 % der Engagements),
- Abhängigkeiten von und Auswirkungen auf die biologische Vielfalt, darunter der Wasserverbrauch (40 % der Engagements).

Weitere Engagements sind für den Rest des Jahres 2023 vorgesehen.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagement in grünen Anleihen	12,98%
Engagement in sozialen Anleihen	4,59%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Engagement in Umweltchampions	34,59%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%
Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren)	1,00
Die Liste der Emittenten, mit denen der Anlageverwalter zusammenarbeitet	1,00

... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nicht anwendbar, da es keine vorherigen Referenzzeiträume gab.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Anlagen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung von:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung von erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) der sozialen Integration,
- g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- h) von Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“)) und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen verwickelt waren. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Der Anlageverwalter verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Intensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Bilanz) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Intensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehörten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die der Anlageverwalter als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden zu Folgendem benutzt:

- a. der Entfernung von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und
- b. die Anlageverwaltung über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung sind in den Abschnitten „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie des Teilfonds“ des Fonds in diesem Anhang zu finden).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

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.

Wenn der Anlageverwalter beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte er sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschneiden.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Bei Anleihen, die von souveränen Staaten begeben wurden, waren die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht auf solche Investitionen anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben wurden, standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesen Dienstleistern festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte.

Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde er als nicht investierbar eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- (i) Identifizierung von Emittenten, die als „Best-in-Class“ gelten,
- (ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und
- (iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die 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.

PAI-Indikatoren	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1 (EUR)	1 109,46	64,71%
THG-Emissionen: Scope 2 (EUR)	144,52	64,71%
THG-Emissionen: Scope 3 geschätzt (EUR)	6 075,57	64,71%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2 (EUR)	1 253,97	64,71%
THG-Emissionen: Geschätzte Emissionen insgesamt (EUR)	7 329,55	64,71%
CO2-Bilanz 1&2 (EUR)	53,15	64,71%
Geschätzte CO2-Bilanz (EUR)	310,66	64,71%
THG-Intensität 1 & 2 (EUR)	492,67	88,87%
Geschätzte THG-Intensität (EUR)	1 196,48	88,87%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich fossiler Brennstoffe tätig sind.	5,14%	81,11%
Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien.	62,08%	75,68%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	0,43	6,87%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	11,63	5,14%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	0,06	0,92%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	0,03	1,19%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	0,11	1,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	0,00	0,00%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	0,00%	81,11%
Emissionen in Wasser (EUR)	0,03	3,44%
Gefährliche Abfälle (EUR)	0,09	12,86%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	0,00%	81,11%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne.	0,00%	81,11%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	27,51%	20,65%
Geschlechtervielfalt im Vorstand	38,31%	81,11%
Engagement in umstrittenen Waffen	0,00%	81,11%
THG-Intensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	481,28	2,32%
Investitionsländer, in denen soziale Verstöße vorkommen	0,00	2,32%



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die 15 Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts mit Stand vom 28. Februar 2023 bei Nichtberücksichtigung von liquiden Mitteln und Derivaten waren wie folgt:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 2023-01-23 - 2023-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	Anteil	Land
Internationale Anleihe der rumänischen Regierung, 2,125 %, fällig am 03/07/2028 REG S	Staatsanleihen	2,36%	Rumänien
Caixa Geral De Depositos SA 5,75 % 10/31/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	2,28%	Portugal
Morgan Stanley 4,813 % 10/25/2028 *FIXED TO FLOAT*	Finanzen	2,24%	USA
Crelan SA 5,75 % 01/26/2028 REG S	Finanzen	2,20%	Belgien
Natwest Markets PLC 4,25 % 01/13/2028 REG S	Finanzen	2,17%	Vereinigtes Königreich
BPCE SA 4,375 % 07/13/2028 REG S	Finanzen	2,16%	Frankreich
ABN AMRO Bank NV 4 % 01/16/2028 REG S	Finanzen	2,15%	Niederlande
Orano SA 2,75 % 03/08/2028 REG S	Industrie	2,04%	Frankreich
AIB Group PLC 2,25 % 04/04/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	2,01%	Irland
Engie SA 1,75 % 03/27/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	2,00%	Frankreich
Intesa Sanpaolo Spa 1,75 % 03/20/2028 REG S	Finanzen	1,94%	Italien
Abanca Corp Bancaria SA 5,25 % 09/14/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	1,93%	Spanien
Commerzbank AG 4,625 % 03/21/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	1,92%	Dänemark
La Banque Postale SA 1 % 02/09/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	1,89%	Frankreich
Barclays PLC .877 % 01/28/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzen	1,88%	Vereinigtes Königreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

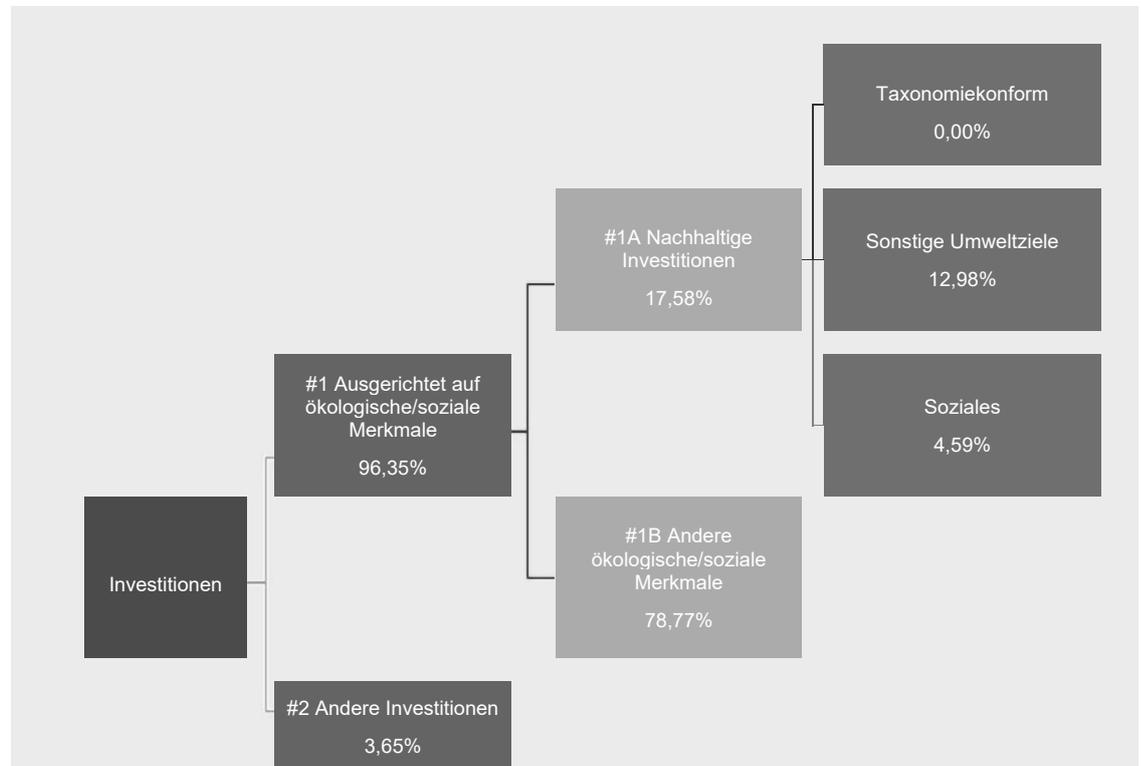
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 17,58 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,35 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,65 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 17,53 % seines Portfolios in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren dieses Finanzprodukts waren mit Stand vom 28. Februar 2023 wie folgt:

Wichtigster Sektor	Anteil
Finanzen	53,77%
Industrie	13,13%
Versorgungsunternehmen	7,01%
Informationstechnologie	6,81%
Zyklische Konsumgüter	3,79%
Grundstoffe	3,10%
immobilien	2,38%
Staatsanleihen	2,36%
Kommunikationsdienste	2,17%
Gesundheitssektor	2,06%

Wichtigster Teilsektor	Anteil
Banken	39,02%
Diversifizierte Finanzwerte	13,71%
Versorgungsunternehmen	7,01%
Verkehr	6,51%
Software und Dienstleistungen	4,27%
Investitionsgüter	4,06%
Grundstoffe	3,10%
Kommerzielle und gewerbliche Dienstleistungen	2,56%
Technologie-Hardware und Ausrüstung	2,54%
immobilien	2,38%
Staatsanleihen	2,36%
Telekommunikationsdienste	2,17%
Medizinische Geräte und Dienstleistungen	2,06%
Gebrauchsgüter und Bekleidung	2,00%
Einzelhandel	1,78%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionsswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

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



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

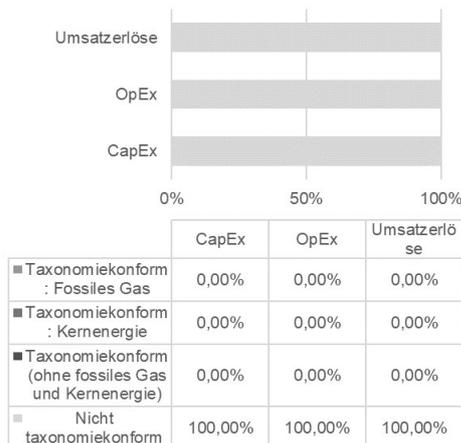
Der Fonds tätigte keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

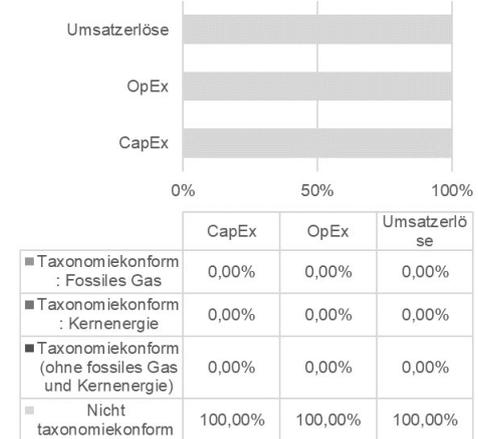
- Ja
 In fossiles Gas In Kernenergie
 Nein

In den beiden nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Mindestprozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform sind. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomie-Konformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt 100,00 % der Gesamtinvestitionen wieder.

* Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

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.

● **Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und Stützungstätigkeiten.

● **Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Nicht zutreffend

 sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.

 **Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?**

Am Ende des Referenzzeitraums betragen die Anlagen des Portfolios des Fonds mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist, 12,98 %.

Als Ergebnis der Anlagestrategie des Fonds tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

 **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 4,59 %.

 **Welche Investitionen fielen unter „#2 Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

Der Anteil der Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ lag bei 3,65 % 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?

Die folgenden Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen:

A. Um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewirbt, wurden Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen.

B. Der Anlageverwalter verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen. Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Der Anlageverwalter verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Intensität einstuft.

C. Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm der Anlageverwalter eine zusätzliche qualitative Bewertung (d. h. das Bewertungsformular zu nachhaltigen Anlagen auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

D. Der Fonds wendete eine eigene ESG-Ratingmethodik an, um Anlagen in Emittenten zu vermeiden, die bei der Umstellung auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zurückliegen. Die ESG-Ratingmethode wurde auf mindestens 90 % des Fondsportfolios angewendet und war für den Aufbau des Portfolios verbindlich. Der Fonds wendete einen selektiven Ansatz an, um Emittenten (Unternehmen und Staaten) aus seinem Portfolio auszuschließen, die in Bezug auf diese Kennzahlen zu den unteren 20 % seines Anlageuniversums gehörten.

E. Die 5 von 64 eindeutig definierten Emittenten (8 %), mit denen man interagiert, bilden 9 % der Beteiligungen und repräsentieren 9,5 % des NIW des Fonds mit Stand vom 28. Februar 2023. Wir taten dies per E-Mail, in direkten Video-Gesprächen, über die Teilnahme an Roadshows oder mittels persönlicher Meetings. Wir interagieren weiterhin mit den Emittenten, bei denen wir Beteiligungen besitzen. Weitere Informationen zu Interaktionen sind in den obigen Abschnitten enthalten.



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

