

Jahresbericht und geprüfter Abschluss

Franklin Templeton
Global Funds Plc

Ein Dachfonds mit getrennter Haftung
zwischen den Teilfonds

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026

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

Inhaltsverzeichnis

Allgemeine Informationen	3
Brief an die Anteilsinhaber	15
Bericht des Verwaltungsrats	16
Bericht der Verwahrstelle	19
Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer	20
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	22
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	24
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	32
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	40
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US High Yield Fund	45
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	49
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	53
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	55
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	58
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	62
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	65
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	74
Anlagenportfolio – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	79
Anlagenportfolio – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	86
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	91
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	93
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	95
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	98
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	100
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	103
Anlagenportfolio – FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	104
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Value Fund	105
Anlagenportfolio – FTGF Putnam US Research Fund	107
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	110
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	111
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	113
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	115
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	117
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	119
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	121
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	123
Anlagenportfolio – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	126
Anlagenportfolio – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	128
Anlagenportfolio – Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	129
Anlagenportfolio – Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	130
Anlagenportfolio – FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	131
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	132
Anlagenportfolio – Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	133
Anlagenportfolio – FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund [^]	134
Anlagenportfolio – FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^]	135
Anlagenportfolio – FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	141
Anlagenportfolio – FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	145
Anlagenportfolio – FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	146
Anlagenportfolio – FTGF Putnam Balanced Fund [^]	148
Anlagenportfolio – FTGF Putnam Global Healthcare Fund	153
Bilanz – Franklin Templeton Global Funds Plc	154
Gesamtergebnisrechnung – Franklin Templeton Global Funds Plc	174
Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens – Franklin Templeton Global Funds Plc	184
Erläuterungen zum Abschluss – Franklin Templeton Global Funds Plc	217

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Inhaltsverzeichnis – (Fortsetzung)

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	280
Ergänzende Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft) – Franklin Templeton Global Funds Plc	286
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	296
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Bond Fund	296
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	296
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	297
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US High Yield Fund	297
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global High Yield Fund	297
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	298
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	298
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	298
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	299
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	299
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	299
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	300
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund [^]	300
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	301
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	301
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	302
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	302
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	302
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	303
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	303
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	303
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	304
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Value Fund	304
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Putnam US Research Fund	305
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	305
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund [^]	305
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	306
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	306
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	307
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	308
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	308
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	309
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	309
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce US Smaller Companies Fund	309
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	310
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	311
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	311
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	312
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	312
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund [^]	312
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^]	313
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	313
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Putnam Balanced Fund [^]	314
Aufstellung der wichtigsten Portfolioveränderungen (ungeprüft) – FTGF Putnam Global Healthcare Fund	315
Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)	316
Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)	317
Anhang: Offenlegung von Geschäften mit verbundenen Personen (ungeprüft)	318
Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)	319

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Allgemeine Informationen

Verwaltungsrat

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

Geschäftssitz

Bis zum 3. Juni 2025:
 Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Ab dem 3. Juni 2025:
 The Shipping Office
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 Irland

Secretary

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

Hauptvertriebs- und Hauptinformationsstelle

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

Weitere Vertriebs- und Informationsstellen

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

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

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

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

Berichtsfondsstatus und Ausschüttungsfondsstatus (nur für britische Anteilsinhaber)

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

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

Schweizer Vertreter

First Independent Fund Services Ltd
 Feldeggrasse 12
 CH-8008 Zürich
 Schweiz

Schweizer Zahlstelle

NPB Neue Privat Bank AG
 Limmatquai 1
 CH-8001 Zürich
 Schweiz

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

Irischer Rechtsberater

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

Verwahrstelle

The Bank of New York Mellon SA/NV, Niederlassung Dublin
Bis zum 3. Juni 2025:
 Riverside Two
 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 KV60
 Irland

Ab dem 3. Juni 2025:
 The Shipping Office
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 Irland

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Verwaltungsstelle

BNY Mellon Fund Services (Ireland) Designated Activity Company
Bis zum 3. Juni 2025:
 One Dockland Central
 Guild Street, IFSC
 Dublin 1, D01 E4X0
 Irland

Ab dem 3. Juni 2025:
 The Shipping Office
 20-26 Sir John Rogerson's Quay
 Grand Canal Dock
 Dublin 2, D02 Y049
 Irland

Verwalter und Promoter

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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund ^a	27. Februar 2004	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
FTGF Western Asset US Core Bond Fund*	30. August 2002	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund*	20. April 2007	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund ^{a**b}	1. Oktober 2003 (Handel eingestellt am 29. Juli 2024)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund ^{a**b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 16. Februar 2023)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund*	29. August 2002	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset US High Yield Fund*	27. Februar 2004	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund ^{^*b}	24. Februar 2004 (Handel eingestellt am 10. Oktober 2022)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset Global High Yield Fund*	20. April 2007	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund ^{^*b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 8. November 2019)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA
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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund*	12. Juni 2008	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd. 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund*	3. Juni 2009	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset Global Bond Fund^* (vormals FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund, umbenannt am 31. Oktober 2025)	3. Dezember 2010	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
FTGF Western Asset Global Credit Fund^*	19. November 2010	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^{a,b}	5. September 2013 (Handel eingestellt am 29. Oktober 2024)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^{a*}	16. Dezember 2015	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 Distribuidora de Títulos e Valores Mobiliários Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145 Western Asset Management Company Ltd. Shin-Marunouchi Building 5-1 Marunouchi 1-Chome, Chiyoda-ku Tokio 100-6536 Japan
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^{a*}	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^{a*}	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

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund^{^*b}	17. November 2016 (Handel eingestellt am 23. Oktober 2023)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund^{^*b}	17. November 2016 (Handel eingestellt am 10. November 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 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 Singapur, 049145 Western Asset Management Company Distribuidora de Titulos e Valores Mobiliarios Limitada Av. Präs. Juscelino Kubitschek No. 1455 – 15th Floor – 04543011 Sao Paulo – Brasilien
FTGF Western Asset Short-Dated High Yield 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
FTGF Western Asset Asian Income Fund^{^*^}		Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^{^*}	11. Januar 2021	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 Sustainable Global Corporate Bond Fund^{^**}	10. Januar 2022 (Handel eingestellt am 5. Dezember 2023)	Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145 Western Asset Management Company Pty Limited Level 48 120 Collins Street Melbourne Vic 3000, Australien
FTGF Western Asset China Bond Fund^{†**^}		Anlageverwalter: Western Asset Management Company Limited 10 Exchange Square Primrose Street London EC2A 2EN Vereinigtes Königreich Unteranlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA Western Asset Management Company Pte. Ltd 1 George Street, #23-01 Singapur, 049145
FTGF Western Asset US Dollar Liquidity 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
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund[*]	1. Oktober 2003	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^{^*}	3. April 2012	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^{^*}	30. November 2012	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund*	25. Juni 2010	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund*	3. Juni 2013	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^{^*b}	30. Juni 2014 (Handel eingestellt am 4. August 2025)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^{^*a}	6. April 2017 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund^{^*ab}	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^{^*ab}	16. August 2018 (Handel eingestellt am 17. Juli 2024)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund^{^*ab}	1. Dezember 2022 (Handel eingestellt am 19. Dezember 2024)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^{^*a}	6. November 2023	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^{^***}	31. Dezember 2015 (Handel eingestellt am 24. März 2023)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global – EM Macro Bond Fund^{^*a}		Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund^{^*ab}	24. März 2025 (Handel eingestellt am 15. Juni 2026)	Anlageverwalter: Brandywine Global Investment Management, LLC 1735 Market Street Suite 1800 Philadelphia, Pennsylvania 19103 USA
FTGF ClearBridge US 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^{^***}	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 15. Februar 2019)	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Putnam US Research Fund** (vormals FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, umbenannt am 28. April 2025)	20. April 2007	Anlageverwalter: <i>Bis zum 28. April 2025:</i> ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA <i>Ab dem 28. April 2025:</i> The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund**	20. April 2007	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**^b (mit Wirkung vom 31. Oktober 2025 verschmolzen mit dem FTGF ClearBridge Global Growth Leaders 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** (mit Wirkung vom 8. Mai 2026 verschmolzen mit dem FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund)	3. Juni 2013	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund^{***}	30. September 2015	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund^{***^}	29. Juni 2018	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^{***^} (vormals FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund, umbenannt am 28. April 2025)	22. September 2023	Anlageverwalter: ClearBridge Investments, LLC 620 Eighth Avenue, 48th Floor New York, New York 10018 USA
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^{***^}	9. Dezember 2016	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund**	30. April 2021	Anlageverwalter: ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund**	8. November 2002	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce US Smaller Companies Fund**	1. März 2004	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^{***}	1. Dezember 2021	Anlageverwalter: Royce & Associates, LP 745 5th Avenue New York, New York 10151 USA
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^{***b}	30. August 2002 (Handel eingestellt am 11. Juli 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund^{***b}	25. Februar 2004 (Handel eingestellt am 17. Juli 2023)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund^{***b}	20. April 2007 (Handel eingestellt am 25. Februar 2015)	
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund^{***b}	28. April 2008 (Handel eingestellt am 14. April 2021)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^{***b}	29. Dezember 2010 (Handel eingestellt am 27. April 2022)	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
Legg Mason QS US Large Cap Fund^{***b}		Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund^{***b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 20. April 2023)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Unteranlageverwalter: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund^{***b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 21. August 2019)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Unteranlageverwalter: Templeton Asset Management Ltd. 7 Temasek Boulevard, #38-03 Suntec Tower One Singapore 038987
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund^{***b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 31. Juli 2017)	
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund^{***b}	11. März 2016 (Handel eingestellt am 15. November 2019)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^{***b} (vormals FTGT Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund, umbenannt am 14. Juli 2025)	28. Juni 2016 (Handel eingestellt am 12. Januar 2026)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd (bis 14. Juli 2025) Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Franklin Templeton Investment Management Limited (seit 14. Juli 2025) Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund^{***b}	28. Juni 2016 (Handel eingestellt am 26. Juli 2024)	Anlageverwalter: Franklin Templeton Australia Limited Level 47 120 Collins Street, Melbourne VIC 3000 Australien

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund**^ (vormals FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund, umbenannt am 30. September 2025)	24. November 2017	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd (bis 30. September 2025) Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland ClearBridge Investment Management Limited (seit 30. September 2025) 5 Morrison Street Level 2 Edinburgh EH3 8BH Schottland
FTGF Martin Currie European Select Absolute Alpha Fund**+^		Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGT Franklin European Unconstrained Fund**^b (vormals FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund, umbenannt am 14. Juli 2025)	9. November 2018 (Handel eingestellt am 18. August 2025)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd (bis 14. Juli 2025) Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland Franklin Templeton Investment Management Limited (seit 14. Juli 2025) Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Martin Currie Improving Society Fund**^b	20. Juni 2023 (Handel eingestellt am 7. Juli 2025)	Anlageverwalter: Martin Currie Investment Management Ltd Saltire Court 20 Castle Terrace Edinburgh EH1 2ES Schottland
FTGF Multi-Asset Infrastructure Income Fund****^		Anlageverwalter: Western Asset Management Company, LLC 385 East Colorado Boulevard Pasadena, California 91101 USA ClearBridge Investments (North America) Pty Limited Level 13, 35 Clarence Street Sydney NSW 2000 Australien
Legg Mason US Equity Fund^b	8. Januar 2008 (Handel eingestellt am 24. August 2010, am 13. April 2012 neu gestartet und Handel wieder eingestellt am 30. August 2013)	
Legg Mason Japan Equity Fund^b	2. Oktober 2008 (Handel eingestellt am 30. November 2010)	
Franklin Responsible Income 2028 Fund*^	23. Januar 2023	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
Franklin Responsible Income 2029 Fund*^	27. März 2024	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund**+^ (vormals FTGF Franklin Responsible Income Series 3 Fund, umbenannt am 30. Januar 2026)	17. Februar 2026	Anlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund*^	4. April 2025	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA

Allgemeine Informationen – (Fortsetzung)

Fondsname	Auflegungsdatum des Fonds	Anlageverwalter/Unteranlageverwalter
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund**^	4. April 2025	Anlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund***^	4. April 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund ***^	14. März 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam Balanced Fund ***^	27. Mai 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam Global Healthcare Fund **^	30. Mai 2025	Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA
FTGF Putnam Global Convertibles Fund***		Anlageverwalter: The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA Unteranlageverwalter: Franklin Advisers, Inc. One Franklin Parkway San Mateo, CA 94403 USA
FTGF Pathway to Putnam US Research Fund***	6. März 2026	Anlageverwalter: Franklin Templeton International Services S.à r.l 8A, rue Albert Borschette L-1246 Luxemburg Großherzogtum Luxemburg Unteranlageverwalter: Franklin Templeton Investment Management Limited Cannon Place 78 Cannon Street London EC4N 6HL Vereinigtes Königreich The Putnam Advisory Company, LLC 100 Federal Street Boston, Massachusetts 02110 USA

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Verkauf zugelassen.

μ Money Market Fund.

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

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

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

Ⓟ Bis zum Widerruf der Genehmigung durch die Zentralbank.

π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 7. Mai 2026 von der Zentralbank widerrufen.

Weitere Informationen

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

Für professionelle Anleger in Europa (außer VK und Schweiz)

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

www.franklinresources.com

Für zugelassene Broker in Nord-, Süd- und Mittelamerika

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

www.franklintempletonoffshore.com

Auf den jeweiligen Internetseiten finden Sie Informationen über:

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

Brief an die Anteilsinhaber

Sehr geehrte Anteilsinhaberin, sehr geehrter Anteilsinhaber,

wir freuen uns, Ihnen den Jahresbericht für Franklin Templeton Global Funds Plc (die „Gesellschaft“) für den Zwölfmonatszeitraum zum 28. Februar 2026 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 Weltwirtschaft hat einige Herausforderungen gemeistert und ihr Wachstum im Berichtszeitraum fortgesetzt. In seinem *World Economic Outlook Update* vom Januar 2026 erklärte der Internationale Währungsfonds (IWF): „Das globale Wachstum dürfte 2026 mit 3,3 % und 2027 mit 3,2 % robust bleiben – Werte, die dem für 2025 geschätzten Ergebnis von 3,3 % entsprechen. Die Prognose sieht für 2026 eine leichte Aufwärtskorrektur und für 2027 keine Änderung gegenüber dem World Economic Outlook (WEO) vom Oktober 2025 vor. Diese gleichmäßige Leistung auf der Oberfläche ist das Ergebnis des Ausgleichs gegensätzlicher Kräfte. Die negativen Auswirkungen der sich wandelnden Handelspolitik werden durch positive Impulse aus den steigenden Investitionen im Technologiebereich, einschließlich künstlicher Intelligenz (KI) – in Nordamerika und Asien mehr als in anderen Regionen –, sowie durch fiskal- und geldpolitische Unterstützung, allgemein expansive finanzielle Rahmenbedingungen und die Anpassungsfähigkeit des Privatsektors ausgeglichen.“ Aus regionaler Sicht geht der IWF davon aus, dass das BIP in den USA 2026 um 2,4 % wachsen wird (2025: 2,1 %). Der IWF prognostiziert, dass das BIP im Jahr 2026 in der Eurozone bei 1,3 % (gegenüber 1,4 % im Jahr 2025), 1,3 % im Vereinigten Königreich (gegenüber 1,4 % im Jahr 2025) und 0,7 % in Japan (gegenüber 1,1 % im Jahr 2025) liegen wird.

Marktüberblick – Rentenmärkteⁱ

Der globale Rentenmarkt erfuhr Phasen der Volatilität, erzielte im Berichtszeitraum jedoch eine positive Rendite. Im Jahr 2025 blieb die US-Notenbank (Fed) auf ihren ersten fünf Sitzungen in Wartestellung, da sie ihre Entscheidung gegen die Auswirkungen der Zölle von Präsident Trump auf die Wirtschaft und die Inflation abwog. Auf ihren Sitzungen im September, Oktober und Dezember 2025 senkte sie dann die Zinssätze und begründete dies mit der Sorge um den Arbeitsmarkt. Die US-Notenbank hielt dann auf ihrer Sitzung im Januar 2026 an ihrem Kurs fest. Die Europäische Zentralbank senkte die Zinssätze zwischen Januar 2025 und Juni 2025 viermal, beließ sie dann aber in den übrigen Monaten des Berichtszeitraums unverändert. Die Bank of England senkte die Zinssätze im Berichtszeitraum dreimal (im Mai, August und Dezember 2025). Insgesamt erzielten globale Anleihen, gemessen am Bloomberg Global Aggregate Bond Index, in den 12 Monaten zum 28. Februar 2026 eine Rendite von 8,23 %. US-Unternehmensanleihen mit niedrigerem Rating und auf US-Dollar lautende Schwellenländer-Staatsanleihen erzielten im Berichtszeitraum stärkere Renditen.

Marktüberblick – Globale Aktienⁱⁱ

Der globale Aktienmarkt verzeichnete im Berichtszeitraum sehr starke Ergebnisse. Der Markt wurde durch insgesamt solide Unternehmensergebnisse, eine starke Anlegernachfrage und die robuste Weltwirtschaft unterstützt. Im Berichtsjahr zum 28. Februar 2026 rentierte der S&P 500 Index mit 16,99 %. Außerhalb der USA verzeichneten internationale Industrieländeraktien, gemessen am MSCI EAFE Index (net), einen Zuwachs von 34,63 %, während Schwellenländeraktien, gemessen am Emerging Markets Index (net), mit 49,96 % rentierten.

Wir danken Ihnen für Ihr anhaltendes Vertrauen.

Mit freundlichen Grüßen

Franklin Templeton International Services S.à r.l

März 2026

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

Alle Daten entsprechen dem Stand vom 28. Februar 2026, sofern nichts anderes angegeben ist.

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

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

Die Informationen in diesem Dokument stammen aus Quellen, die als zuverlässig gelten, sie werden jedoch nicht durch ein Unternehmen der Franklin Resources, Inc. oder durch ein mit der Franklin Resources, Inc. verbundenes Unternehmen (zusammen „Franklin Templeton“) garantiert. Es handelt sich auch nicht um eine vollständige Zusammenfassung oder Darstellung aller verfügbaren Daten.

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

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

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

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

ⁱ Rentenwerte – Anleihen.

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

Bericht des Verwaltungsrats

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft („Verwaltungsrat“) legt seinen Jahresbericht zusammen mit dem geprüften Abschluss für das am 28. Februar 2026 beendete Geschäftsjahr vor.

Erklärung zu den Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

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

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

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

Bei der Erstellung dieses Abschlusses muss der Verwaltungsrat:

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

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

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

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

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

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

Überblick über die Geschäftstätigkeit und zukünftige Entwicklungen

Der Brief an die Anteilshaber auf Seite 15 beinhaltet eine Darstellung der Faktoren, die zur Performance der Fonds im Berichtsjahr beigetragen haben. Der Verwaltungsrat erwartet keine Veränderungen hinsichtlich der Anlageziele der bestehenden Fonds.

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

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

Zum 28. Februar 2026 hat das Unternehmen 43 aktive Fonds (28. Februar 2025: 40 Fonds). Einzelheiten zu ihren Nettoinventarwerten am Ende des Geschäftsjahrs sind der Bilanz auf den Seiten 154 bis 173 zu entnehmen.

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

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

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

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

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

Mit Wirkung vom 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 31. Oktober 2025 wurde der FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^] mit dem FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund verschmolzen.

Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 stellte der Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] den Handel auf.

Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsamen und Verschmelzungen sind der Erläuterung 14 zu entnehmen.

Risikomanagement – Ziele und Richtlinien

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Ergebnisse des Berichtsjahres und Finanzlage zum Ende des Berichtsjahres

Die Bilanz zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 und die Gesamtergebnisrechnung für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 sind auf den Seiten 154 bis 173 bzw. 174 bis 183 dargelegt.

Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Die Ausschüttungen an die Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen für die am 28. Februar 2026 und am 28. Februar 2025 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.

Mitglieder des Verwaltungsrats

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

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

Beteiligungen der Verwaltungsratsmitglieder und des Sekretärs

Der Verwaltungsrat bzw. der Gesellschaftssekretär und deren Familien besitzen keine Beteiligungen an den Anteilen der Gesellschaft zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025. 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 Anteilsinhaber des OGAW durchgeführt wird“.

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

Unabhängige Wirtschaftsprüfer

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

Anlageziele und Anlagepolitik

Alle aktiven Fonds, außer dem FTGF Western Asset Global Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^], FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^], FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^], FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^], FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^] und FTGF Putnam Balanced 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.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht des Verwaltungsrats – (Fortsetzung)

Anlageziele und Anlagepolitik (Fortsetzung)

Das Hauptanlageziel und die Anlagerichtlinien aller Fonds sind im entsprechenden Nachtrag zum Verkaufsprospekt 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- und Artikel-9-Produkte gemäß SFDR

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

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

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

Taxonomie

Transparenz über ökologisch nachhaltige Investitionen in periodischen Berichten

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

Die den Fonds, die Gegenstand dieser periodischen Berichterstattung gemäß RTS sind, zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen oder berücksichtigten (bis zu dem Zeitpunkt, zu dem sie den Handel einstellten) nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten, einschließlich ermöglichender Tätigkeiten oder Übergangstätigkeiten im Sinne der Verordnung (EU) 2020/852 (die „Taxonomieverordnung“). Daher kann es sein, dass der Fonds keine Anlagen hält, deren Wirtschaftstätigkeiten als ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomieverordnung gelten. Gemäß seiner ESG-Methodik kann ein Artikel-8-Fonds jedoch Investments halten, die einen Beitrag zur Begrenzung des Klimawandels und zur Anpassung an den Klimawandel leisten. Anleger werden darauf hingewiesen, dass der Grundsatz „Keine erhebliche Beeinträchtigung“ gemäß der Taxonomie-Verordnung nur für diejenigen einem Artikel-8-Fonds zugrunde liegenden Anlagen gilt, bei denen die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten berücksichtigt sind. Bei den Anlagen, die dem übrigen Teil eines Artikel-8-Fonds zugrunde liegen, sind nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Taxonomie-Verordnung berücksichtigt. Die obige Erklärung gilt bzw. galt (bis zu dem Zeitpunkt, zu dem der betreffende Fonds den Handel einstellte) für die folgenden Artikel-8-Fonds: FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund, FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge US Value Fund, FTGF Putnam US Research Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^], FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^], FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^], FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^], FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^], FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^] und FTGF Putnam Global Healthcare Fund.

Der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] war (bis zur Einstellung des Handels) ein nachhaltiger Fonds gemäß den Anforderungen von Artikel 9 SFDR.

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

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied

16. Juni 2026

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Bericht der Verwahrstelle

Bericht der Verwahrstelle an die Anteilsinhaber 16. Juni 2026

Für den Berichtszeitraum vom 1. März 2025 bis 28. Februar 2026 (der „Berichtszeitraum“)

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

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

Verantwortlichkeiten der Verwahrstelle

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

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

Grundlage des Bestätigungsvermerks der Verwahrstelle

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

Bestätigungsvermerk

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

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

Für und im Auftrag der Bank of New York Mellon SA/NV,
Niederlassung Dublin
The Shipping Office
20-26 Sir John Rogerson's Quay
Grand Canal Dock
Dublin 2, D02 Y049
Irland

Bericht der unabhängigen Abschlussprüfer

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

Bericht über die Prüfung des Jahresabschlusses

Prüfungsurteil

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

- ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und der Teilfonds zum 28. Februar 2026 sowie der Ergebnisse für das an diesem Datum endende Geschäftsjahr vermittelt,
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit der allgemein anerkannten Rechnungslegungspraxis in Irland (vom Financial Reporting Council des Vereinigten Königreichs herausgegebene Rechnungslegungsstandards, einschließlich Financial Reporting Standard 102 „The Financial Reporting Standard applicable in the UK and Republic of Ireland“ und irisches Recht) erstellt wurde, und
- ordnungsgemäß in Übereinstimmung mit den Anforderungen des Companies Act 2014 und der European Communities (Undertakings for Collective Investment in Transferable Securities) Regulations 2011 (in der jeweils gültigen Fassung) erstellt wurde.

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

- die Bilanz zum 28. Februar 2026,
- die Gesamtergebnisrechnung für das an diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr,
- die Aufstellung über die Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- das Anlagenportfolio für jeden der Teilfonds zum 28. Februar 2026 und
- den Anhang zum Jahresabschluss für die Gesellschaft und jeden ihrer Teilfonds nebst Beschreibung der Rechnungslegungsgrundsätze.

Grundlage für das Prüfungsurteil

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

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

Unabhängigkeit

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

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

Bei unserem Prüfungsurteil zum Jahresabschluss, das sich nicht ändert, weisen wir auf Erläuterung 2 zum Abschluss hin, in dem die Gründe genannt sind, warum der Jahresabschluss des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return 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[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason 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[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^], FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt wurde.

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung

Mit Ausnahme des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason 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[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^], FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], bei denen ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in dem „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ erläutert, haben wir auf der Grundlage unserer Prüfungshandlungen keine wesentlichen Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen festgestellt, die einzeln oder zusammen erhebliche Zweifel an der Fortführungsfähigkeit der Gesellschaft oder ihrer Teilfonds für mindestens die nächsten zwölf Monate ab dem Datum, an dem der Abschluss zur Veröffentlichung freigegeben wurde, aufwerfen könnten.

Mit Ausnahme des FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund[^], Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund[^], Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund[^], Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund[^], FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^], FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund[^], FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^], FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global - US High Yield Fund[^], FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^], FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^], FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], Legg Mason ClearBridge Growth Fund[^], FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^], FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, Legg Mason US Equity Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund[^], Legg Mason 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[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund[^], Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund[^], Legg Mason Martin Currie Greater China Fund[^], FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^], FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], bei denen ein anderer Grundsatz als das Fortführungsprinzip zugrunde gelegt wurde, wie oben in dem „Zusatz – Abschluss auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt“ erläutert, sind wir bei der Prüfung des Jahresabschlusses zu dem Schluss gelangt, dass die Anwendung des Fortführungsprinzips bei der Erstellung des Abschlusses durch den Verwaltungsrat angemessen ist.

Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers – (Fortsetzung)

Schlussfolgerungen in Bezug auf die Unternehmensfortführung – (Fortsetzung)

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

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

Berichterstattung über andere Informationen

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

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

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

- Nach unserer Beurteilung aufgrund der bei der Prüfung durchgeführten Handlungen stimmen die Angaben im Bericht des Verwaltungsrats für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 mit dem Jahresabschluss überein und wurden in Übereinstimmung mit den anwendbaren gesetzlichen Vorschriften erstellt.
- Auf der Grundlage unserer Kenntnisse und unseres Verständnisses der Gesellschaft und ihres Umfelds, die wir bei der Prüfung gewonnen haben, haben wir keine wesentlichen fehlerhaften Angaben im Bericht des Verwaltungsrats festgestellt.

Verantwortlichkeiten für den Jahresabschluss und die Abschlussprüfung

Verantwortlichkeiten der Directors für den Abschluss

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

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

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

Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers für die Prüfung des Jahresabschlusses

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

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

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

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

Diese Beschreibung ist Teil unseres Bestätigungsvermerks.

Verwendung dieses Berichts

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

Andere erforderliche Berichte

Companies Act 2014 Stellungnahmen zu anderen Angelegenheiten

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

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

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 69,73 % (28. Februar 2025: 75,43 %)					
USA – 69,73 % (28. Februar 2025: 75,43 %)					
25.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,695 %, fällig 02.03.2026 *	25.000	1,21	15.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.05.2026	14.907	0,72
1.200 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,820 %, fällig 11.03.2026 *	1.200	0,06	5.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.07.2026	4.932	0,24
2.586 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,820 %, fällig 13.03.2026 *	2.586	0,12	25.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 31.07.2026	24.629	1,19
25.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,710 %, fällig 19.03.2026 *	25.000	1,21	25.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.08.2026	24.580	1,19
1.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,725 %, fällig 27.03.2026 *	1.000	0,05	25.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 21.08.2026	24.577	1,19
25.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,740 %, fällig 27.03.2026 *	25.000	1,21	5.000 Federal Home Loan Banks, 4,500 %, fällig 13.03.2026	5.000	0,24
11.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,715 %, fällig 02.04.2026 *	11.000	0,53	3.000 Federal Home Loan Banks, 3,745 %, fällig 23.03.2026 *	3.000	0,14
1.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,810 %, fällig 08.04.2026 *	1.000	0,05	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,705 %, fällig 25.03.2026 *	25.000	1,21
1.100 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,720 %, fällig 17.04.2026 *	1.100	0,05	2.000 Federal Home Loan Banks, 3,745 %, fällig 26.03.2026 *	2.000	0,10
2.820 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,820 %, fällig 21.04.2026 *	2.820	0,14	1.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,745 %, fällig 27.03.2026 *	1.000	0,05
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,765 %, fällig 08.05.2026 *	10.000	0,48	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0005, 1,000 %, fällig 30.03.2026	9.976	0,48
1.720 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,830 %, fällig 08.05.2026 *	1.720	0,08	3.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,745 %, fällig 30.03.2026 *	3.000	0,14
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,760 %, fällig 14.05.2026 *	10.000	0,48	5.575 Federal Home Loan Banks, 3,810 %, fällig 02.04.2026 *	5.575	0,27
25.030 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,800 %, fällig 14.05.2026 *	25.032	1,21	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,725 %, fällig 06.04.2026 *	20.000	0,97
23.720 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,800 %, fällig 21.05.2026 *	23.722	1,15	1.000 Federal Home Loan Banks, 3,725 %, fällig 08.04.2026 *	1.000	0,05
1.870 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,780 %, fällig 22.05.2026 *	1.870	0,09	1.500 Federal Home Loan Banks, 3,820 %, fällig 10.04.2026 *	1.500	0,07
1.093 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,815 %, fällig 26.05.2026 *	1.093	0,05	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,720 %, fällig 15.04.2026 *	10.000	0,48
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,710 %, fällig 28.05.2026 *	14.999	0,73	15.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,710 %, fällig 16.04.2026 *	15.000	0,73
3.700 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,800 %, fällig 28.05.2026 *	3.700	0,18	1.600 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,750 %, fällig 20.04.2026 *	1.600	0,08
6.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,805 %, fällig 03.06.2026 *	6.001	0,29	3.000 Federal Home Loan Banks, 3,750 %, fällig 21.04.2026 *	3.000	0,15
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,735 %, fällig 05.06.2026 *	10.000	0,48	15.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,710 %, fällig 22.04.2026 *	15.000	0,73
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,750 %, fällig 09.06.2026 *	20.000	0,97	3.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,750 %, fällig 23.04.2026 *	3.000	0,14
1.213 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0000, 3,710 %, fällig 12.06.2026 *	1.213	0,06	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 3,710 %, fällig 24.04.2026 *	25.000	1,21
1.890 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,750 %, fällig 12.06.2026 *	1.890	0,09	10.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,715 %, fällig 05.05.2026 *	10.000	0,48
3.229 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,835 %, fällig 15.06.2026 *	3.230	0,16	5.000 Federal Home Loan Banks, 3,730 %, fällig 08.05.2026 *	5.000	0,24
10.950 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,760 %, fällig 18.06.2026 *	10.952	0,53	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,715 %, fällig 11.05.2026 *	20.000	0,97
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,740 %, fällig 06.07.2026 *	10.000	0,48	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 3,710 %, fällig 20.05.2026 *	25.000	1,21
20.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0001, 3,765 %, fällig 30.07.2026 *	20.000	0,97	6.000 Federal Home Loan Banks, 3,800 %, fällig 22.05.2026 *	6.001	0,29
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0002, 3,770 %, fällig 04.09.2026 *	10.000	0,48	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,710 %, fällig 04.06.2026 *	25.000	1,21
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,850 %, fällig 04.09.2026 *	10.004	0,48	1.890 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,750 %, fällig 15.06.2026 *	1.890	0,09
15.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,775 %, fällig 10.09.2026 *	15.000	0,73	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0002, 3,735 %, fällig 22.06.2026 *	25.000	1,21
11.550 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, 3,775 %, fällig 18.09.2026 *	11.550	0,56	5.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,740 %, fällig 29.06.2026 *	5.000	0,24
10.000 Federal Farm Credit Banks Funding Corp, Series 0002, 3,670 %, fällig 18.12.2026 *	9.996	0,48	20.000 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,760 %, fällig 20.07.2026 *	20.000	0,97
20.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.03.2026	19.970	0,97	25.000 Federal Home Loan Banks, Series 0001, 3,740 %, fällig 21.07.2026 *	25.000	1,21
12.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 31.03.2026	11.966	0,58	4.500 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,810 %, fällig 23.10.2026 *	4.502	0,22
15.000 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.05.2026	14.890	0,72	4.500 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,750 %, fällig 06.11.2026 *	4.500	0,22
8.225 Federal Farm Credit Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.07.2026	8.118	0,39	3.100 Federal Home Loan Banks, 3,770 %, fällig 04.01.2027 *	3.100	0,15
20.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.03.2026	19.992	0,97	3.500 Federal Home Loan Banks, Series 0000, 3,825 %, fällig 25.01.2027 *	3.502	0,17
12.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 19.03.2026	11.980	0,58	1.250 Federal Home Loan Mortgage Corp, 3,820 %, fällig 05.03.2026 *	1.250	0,06
48.380 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.03.2026	48.289	2,34	1.200 Federal Home Loan Mortgage Corp, 3,825 %, fällig 02.04.2026 *	1.200	0,06
16.744 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.03.2026	16.704	0,81	1.600 Federal Home Loan Mortgage Corp, 3,820 %, fällig 07.05.2026 *	1.600	0,08
2.981 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 01.04.2026	2.972	0,14	10.000 Freddie Mac Discount Notes, Series RB, Nullkupon, fällig 02.03.2026	10.000	0,48
10.300 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.04.2026	10.264	0,50	22.200 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.03.2026	22.198	1,07
25.000 Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.04.2026	24.899	1,20	15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 10.03.2026	14.988	0,72
			50.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.03.2026	49.949	2,42
			20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 17.03.2026	19.970	0,97
			25.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 19.03.2026	24.957	1,21
			25.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.03.2026	24.945	1,21
			10.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 31.03.2026	9.970	0,48
			15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.04.2026	14.945	0,72
			20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 09.04.2026	19.925	0,96
			20.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 14.04.2026	19.913	0,96
			50.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.04.2026	49.777	2,41
			25.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.04.2026	24.874	1,20
			15.000 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 28.05.2026	14.867	0,72
			7.300 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	7.261	0,35
			10.000 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.04.2026	10.018	0,48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)		
USA – (Fortsetzung)		
9.000 United States Treasury Note/Bond, 0,875 %, fällig 30.06.2026	8.906	0,43
10.000 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.06.2026	10.020	0,48
23.500 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 31.07.2026	23.324	1,13
19.500 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.07.2026	19.521	0,94
20.000 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.09.2026	19.979	0,97
6.000 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 30.11.2026	5.893	0,28
6.000 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 30.11.2026	5.915	0,29
6.000 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 30.11.2026	6.032	0,29
7.500 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 31.12.2026	7.361	0,36
10.000 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 31.12.2026	9.856	0,48
6.000 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 31.12.2026	6.033	0,29
18.000 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.01.2027	18.067	0,87
4.000 United States Treasury Note/Bond, 1,125 %, fällig 28.02.2027	3.906	0,19
4.000 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 28.02.2027	4.022	0,19
6.000 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.03.2027	6.044	0,29
	1.441.979	69,73
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.441.979 \$)	1.441.979	69,73
Umgekehrte Pensionsgeschäfte – 30,28 % (28. Februar 2025: 26,03 %)		
USA – 30,28 % (28. Februar 2025: 26,03 %)		
175.000 Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 175.053.375 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 178.554.454 USD), 3,660 %, fällig 02.03.2026	175.000	8,46
140.000 HSBC Bank USA, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 140.042.467 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 142.843.371 USD), 3,640 %, fällig 02.03.2026	140.000	6,77
150.000 JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 150.045.750 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 153.046.679 USD), 3,660 %, fällig 02.03.2026	150.000	7,26
50.000 Royal Bank of Canada, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 50.015.125 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 51.000.045 USD), 3,630 %, fällig 02.03.2026	50.000	2,42
111.087 TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement zum Rückkauf zu 111.120.974 USD (besichert durch US Treasury Bonds & Notes im Gesamtwert von 113.308.797 USD), 3,670 %, fällig 02.03.2026	111.087	5,37
	626.087	30,28
Summe umgekehrte Pensionsgeschäfte (Anschaffungskosten 626.087 \$)	626.087	30,28
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	2.068.066	100,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	2.068.066	100,01
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-300	-0,01
Gesamtnettvermögen	2.067.766 \$	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 2026.

	% des Gesamt- vermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	69,56
Geldmarktinstrumente	30,20
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 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 10,01 % (28. Februar 2025: 10,65 %)							
150	Abry Liquid Credit CLO 2025-2 Ltd, Series 2025 2A, Class A1, 144A, 4,995 %, fällig 15.01.2038 *	150	0,19	80	CD 2017-CD3 Mortgage Trust, Series 2017 CD3, Class A4, 3,631 %, fällig 10.02.2050	78	0,10
250	Antares CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class A1R, 144A, 5,038 %, fällig 20.04.2038 *	250	0,32	3.253	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,885 %, fällig 15.11.2049 *	7	0,01
190	Apex Credit CLO 2021-II LLC, Series 2021 2A, Class A1AR, 144A, 4,848 %, fällig 20.10.2034 *	190	0,24	183	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-C4, Series 2017 C4, Class A3, 3,209 %, fällig 12.10.2050	181	0,23
200	Apidos CLO XXXVII, Series 2021 37A, Class A, 144A, 5,061 %, fällig 22.10.2034 *	200	0,26	340	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 6,767 %, fällig 25.03.2042 *	347	0,44
250	Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class A1R, 144A, 4,918 %, fällig 25.10.2038 *	251	0,32	430	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Series 2023 R06, Class 1M2, 144A, 6,367 %, fällig 25.07.2043 *	442	0,56
415	Argent Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Certificates Series 2003-W7, Series 2003 W3, Class M1, 4,030 %, fällig 25.09.2033 *	398	0,51	250	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 5,467 %, fällig 25.01.2044 *	252	0,32
220	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2025 4A, Class A, 144A, 4,400 %, fällig 20.02.2032	222	0,28	253	Cross 2024-H2 Mortgage Trust, Series 2024 H2, Class A1, 144A, 6,093 %, fällig 25.04.2069	255	0,33
150	Bayswater Park CLO Ltd, Series 2023 1A, Class AR, 144A, 4,878 %, fällig 20.01.2039 *	150	0,19	1	Fannie Mae Interest Strip 390, Class C3, 6,000 %, fällig 25.07.2038	–	–
450	Birch Grove CLO 8 Ltd, Series 2024 8A, Class A1, 144A, 5,298 %, fällig 20.04.2037 *	452	0,58	3	Fannie Mae Interest Strip 407, Class 41, 6,000 %, fällig 25.01.2038	–	–
340	Black Diamond CLO 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class A1, 144A, 5,318 %, fällig 25.10.2037 *	341	0,44	6	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	1	–
332	Brazos Higher Education Authority Inc, Series 2011 2, Class A3, 5,149 %, fällig 27.10.2036 *	333	0,43	6	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	1	–
260	CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class A1, 144A, 5,058 %, fällig 20.10.2037 *	261	0,33	1	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C2, 3,000 %, fällig 25.04.2027	–	–
25	CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2007-13, Series 2007 13, Class 2A2, 4,588 %, fällig 25.10.2047 *	24	0,03	421	Fannie Mae Interest Strip 440, Class C50, 4,500 %, fällig 25.10.2053	89	0,11
104	CWABS Inc Asset-Backed Certificates Trust 2004-5, Series 2004 5, Class 2A, 4,288 %, fällig 25.10.2034 *	102	0,13	200	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	201	0,26
15	CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2006-F, Series 2006 F, Class 2A1A, 3,914 %, fällig 15.07.2036 *	15	0,02	24	Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01.10.2044	25	0,03
390	Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class A1, 144A, 5,038 %, fällig 25.10.2037 *	391	0,50	11	Fannie Mae Pool 'AB9594', 4,000 %, fällig 01.06.2043	11	0,01
155	Goodleap Sustainable Home Solutions Trust 2023-3, Series 2023 3C, Class A, 144A, 6,500 %, fällig 20.07.2055	155	0,20	161	Fannie Mae Pool 'AH4536', 4,000 %, fällig 01.02.2041	161	0,21
460	Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A21, 144A, 3,445 %, fällig 26.02.2052	449	0,57	6	Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01.05.2040	6	0,01
247	Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class A, 144A, 2,290 %, fällig 20.01.2048	212	0,27	53	Fannie Mae Pool 'AL9397', 3,000 %, fällig 01.10.2046	49	0,06
371	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 4,538 %, fällig 25.02.2034 *	370	0,47	38	Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01.11.2046	37	0,05
152	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-4, Series 2004 4, Class M1, 4,688 %, fällig 25.10.2034 *	149	0,19	29	Fannie Mae Pool 'AL9631', 3,000 %, fällig 01.12.2046	27	0,03
314	Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust 2004-NC8, Series 2004 NC8, Class M1, 4,703 %, fällig 25.09.2034 *	323	0,41	40	Fannie Mae Pool 'AO7501', 4,000 %, fällig 01.06.2042	39	0,05
160	Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class AR2, 144A, 4,972 %, fällig 15.10.2034 *	160	0,20	16	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01.09.2042	15	0,02
270	Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class A1R, 144A, 4,998 %, fällig 20.07.2035 *	271	0,34	15	Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 01.06.2043	14	0,02
460	OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class A1, 144A, 5,168 %, fällig 20.04.2037 *	462	0,59	32	Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	30	0,04
340	Owl Rock CLO III Ltd, Series 2020 3A, Class AR, 144A, 5,518 %, fällig 20.04.2036 *	341	0,44	169	Fannie Mae Pool 'AS7313', 3,500 %, fällig 01.06.2046	163	0,21
36	SLM Private Credit Student Loan Trust 2007-A, Series 2007 A, Class A4A, 4,225 %, fällig 16.12.2041 *	36	0,05	77	Fannie Mae Pool 'AS7738', 3,000 %, fällig 01.08.2046	71	0,09
218	SLM Private Education Loan Trust 2010-C, Series 2010 C, Class A5, 144A, 8,524 %, fällig 15.10.2041 *	229	0,29	46	Fannie Mae Pool 'AS7844', 3,000 %, fällig 01.09.2046	43	0,05
63	SMB Private Education Loan Trust 2020-A, Series 2020 A, Class A2A, 144A, 2,230 %, fällig 15.09.2037	61	0,08	15	Fannie Mae Pool 'AS8740', 3,500 %, fällig 01.02.2037	15	0,02
151	SMB Private Education Loan Trust 2024-A, Series 2024 A, Class A1A, 144A, 5,240 %, fällig 15.03.2056	157	0,20	31	Fannie Mae Pool 'AS8745', 3,000 %, fällig 01.02.2047	29	0,04
213	SMB Private Education Loan Trust 2024-E, Series 2024 E, Class A1A, 144A, 5,090 %, fällig 16.10.2056	218	0,28	36	Fannie Mae Pool 'AS9588', 4,000 %, fällig 01.05.2047	35	0,04
177	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class AA, 144A, 2,301 %, fällig 28.02.2033	173	0,22	13	Fannie Mae Pool 'AT4281', 4,000 %, fällig 01.06.2043	13	0,02
180	Sycamore Tree CLO 2025-6 Ltd, Series 2025 6A, Class A1, 144A, 4,868 %, fällig 20.04.2038 *	180	0,23	20	Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	18	0,02
160	Trestles CLO VII Ltd, Series 2024 7A, Class A1, 144A, 5,048 %, fällig 25.10.2037 *	161	0,21	34	Fannie Mae Pool 'BC0884', 3,000 %, fällig 01.05.2046	31	0,04
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 7.770 \$)		7.837	10,01	51	Fannie Mae Pool 'BC1509', 3,000 %, fällig 01.08.2046	48	0,06
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 38,12 % (28. Februar 2025: 46,90 %)							
220	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2025-FL1 LLC, Series 2025 FL1, Class A, 144A, 5,021 %, fällig 20.01.2043 *	220	0,28	72	Fannie Mae Pool 'BC2817', 3,000 %, fällig 01.09.2046	67	0,09
278	AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 5,906 %, fällig 17.06.2039 *	278	0,36	28	Fannie Mae Pool 'BD2455', 3,000 %, fällig 01.01.2047	26	0,03
210	BANK 2018-BN10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	209	0,27	30	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 01.10.2046	28	0,04
130	Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	129	0,16	152	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 01.02.2056	149	0,19
9.648	Benchmark 2018-B5 Mortgage Trust, Series 2018 B5, Class XA, 0,451 %, fällig 15.07.2051 *	85	0,11	34	Fannie Mae Pool 'BF0163', 5,000 %, fällig 01.11.2046	35	0,05
229	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class A1, 144A, 6,285 %, fällig 25.02.2064	231	0,29	67	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	65	0,08
174	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A1, 144A, 5,803 %, fällig 25.06.2064	176	0,22	142	Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01.06.2057	139	0,18
140	BXMT 2026-FL6 Ltd, Series 2026 FL6, Class A, 144A, 5,150 %, fällig 19.08.2043 *	140	0,18	28	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01.08.2058	28	0,04
				156	Fannie Mae Pool 'BF0646', 2,500 %, fällig 01.06.2062	134	0,17
				11	Fannie Mae Pool 'BM3904', 5,000 %, fällig 01.05.2048	11	0,01
				28	Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01.03.2043	27	0,03
				434	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 01.12.2048	437	0,56
				61	Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 01.11.2050	54	0,07
				60	Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 01.02.2051	50	0,06
				61	Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 01.02.2051	52	0,07
				54	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	0,06
				58	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	48	0,06
				63	Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 01.03.2051	53	0,07
				68	Fannie Mae Pool 'BR4753', 2,000 %, fällig 01.03.2051	58	0,07
				64	Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 01.07.2051	57	0,07
				98	Fannie Mae Pool 'BT1311', 2,000 %, fällig 01.07.2051	82	0,10
				68	Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 01.08.2051	60	0,08
				73	Fannie Mae Pool 'BU1421', 3,000 %, fällig 01.01.2052	67	0,09
				209	Fannie Mae Pool 'BV4195', 3,000 %, fällig 01.03.2052	192	0,24
				68	Fannie Mae Pool 'BW9916', 5,000 %, fällig 01.10.2052	69	0,09
				66	Fannie Mae Pool 'BX0553', 5,500 %, fällig 01.10.2052	67	0,09
				138	Fannie Mae Pool 'BX9419', 5,000 %, fällig 01.03.2053	141	0,18
				233	Fannie Mae Pool 'CA1692', 4,000 %, fällig 01.05.2048	230	0,29
				178	Fannie Mae Pool 'CA7240', 2,500 %, fällig 01.10.2050	157	0,20
				61	Fannie Mae Pool 'CA7531', 3,000 %, fällig 01.10.2050	56	0,07
				132	Fannie Mae Pool 'CB0470', 2,500 %, fällig 01.05.2041	122	0,16
				148	Fannie Mae Pool 'CB3234', 3,000 %, fällig 01.04.2052	135	0,17
				70	Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, fällig 01.07.2052	72	0,09
				460	Fannie Mae Pool 'CB5108', 5,500 %, fällig 01.11.2052	472	0,60
				285	Fannie Mae Pool 'CB6753', 6,000 %, fällig 01.07.2053	298	0,38
				59	Fannie Mae Pool 'CB8226', 6,500 %, fällig 01.03.2054	62	0,08
				35	Fannie Mae Pool 'FM0068', 3,500 %, fällig 01.02.2040	34	0,04
				31	Fannie Mae Pool 'FM0071', 3,500 %, fällig 01.02.2040	30	0,04
				144	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	147	0,19

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			10.394	Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 157, Class X1, 0,254 %, fällig 25.05.2033 *	202	0,26
68 Fannie Mae Pool 'FM2761', 5,000 %, fällig 01.03.2050	69	0,09	52	Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 3,615 %, fällig 01.03.2047 *	51	0,06
81 Fannie Mae Pool 'FM3773', 3,500 %, fällig 01.11.2048	78	0,10	255	Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008 %, fällig 01.11.2048 *	256	0,33
205 Fannie Mae Pool 'FM4650', 2,500 %, fällig 01.10.2040	189	0,24	66	Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 5,156 %, fällig 01.11.2047 *	69	0,09
35 Fannie Mae Pool 'FM5783', 3,000 %, fällig 01.06.2038	34	0,04	79	Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,270 %, fällig 01.02.2050 *	81	0,10
44 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	39	0,05	59	Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01.11.2050	52	0,07
60 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 01.03.2051	54	0,07	63	Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01.11.2050	56	0,07
54 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 01.06.2051	48	0,06	55	Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	0,06
41 Fannie Mae Pool 'FM7786', 4,000 %, fällig 01.01.2049	41	0,05	231	Freddie Mac Pool 'QB9087', 2,000 %, fällig 01.02.2051	196	0,25
47 Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 01.06.2048	47	0,06	64	Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01.07.2051	57	0,07
68 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	60	0,08	64	Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01.08.2051	57	0,07
119 Fannie Mae Pool 'FM8577', 3,000 %, fällig 01.08.2051	110	0,14	209	Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	184	0,24
63 Fannie Mae Pool 'FM8648', 3,000 %, fällig 01.09.2051	58	0,07	73	Freddie Mac Pool 'QC9154', 3,000 %, fällig 01.10.2051	68	0,09
65 Fannie Mae Pool 'FM9365', 3,000 %, fällig 01.11.2051	59	0,08	346	Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	307	0,39
63 Fannie Mae Pool 'FM9464', 3,000 %, fällig 01.11.2051	58	0,07	67	Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig 01.01.2052	60	0,08
78 Fannie Mae Pool 'FP0028', 2,000 %, fällig 01.08.2040	70	0,09	77	Freddie Mac Pool 'RA8790', 5,000 %, fällig 01.04.2053	78	0,10
61 Fannie Mae Pool 'FS0024', 2,500 %, fällig 01.09.2051	54	0,07	186	Freddie Mac Pool 'RB5105', 2,000 %, fällig 01.03.2041	168	0,21
57 Fannie Mae Pool 'FS0037', 3,000 %, fällig 01.08.2051	53	0,07	204	Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, fällig 01.05.2041	177	0,23
66 Fannie Mae Pool 'FS0240', 3,000 %, fällig 01.01.2052	61	0,08	68	Freddie Mac Pool 'RB5121', 2,000 %, fällig 01.08.2041	60	0,08
66 Fannie Mae Pool 'FS0366', 2,500 %, fällig 01.01.2052	59	0,08	69	Freddie Mac Pool 'RB5131', 2,000 %, fällig 01.10.2041	61	0,08
70 Fannie Mae Pool 'FS0995', 2,500 %, fällig 01.03.2042	64	0,08	43	Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	37	0,05
290 Fannie Mae Pool 'FS1112', 2,000 %, fällig 01.03.2052	246	0,31	74	Freddie Mac Pool 'RB5154', 2,500 %, fällig 01.04.2042	68	0,09
70 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 01.03.2052	65	0,08	57	Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	48	0,06
129 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	123	0,16	71	Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	63	0,08
62 Fannie Mae Pool 'FS3249', 5,000 %, fällig 01.11.2052	63	0,08	339	Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	334	0,43
62 Fannie Mae Pool 'FS4000', 6,000 %, fällig 01.07.2041	66	0,08	75	Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, fällig 01.12.2052	77	0,10
72 Fannie Mae Pool 'FS4805', 5,500 %, fällig 01.05.2053	74	0,09	80	Freddie Mac Pool 'SD2443', 4,500 %, fällig 01.10.2052	80	0,10
65 Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, fällig 01.07.2053	67	0,09	65	Freddie Mac Pool 'SD2452', 6,500 %, fällig 01.02.2053	68	0,09
232 Fannie Mae Pool 'FS5450', 3,000 %, fällig 01.11.2051	213	0,27	83	Freddie Mac Pool 'SD2723', 5,500 %, fällig 01.03.2053	85	0,11
83 Fannie Mae Pool 'FS7170', 2,000 %, fällig 01.08.2042	75	0,10	76	Freddie Mac Pool 'SD2762', 5,500 %, fällig 01.05.2053	79	0,10
22 Fannie Mae Pool 'MA1217', 4,000 %, fällig 01.10.2042	21	0,03	69	Freddie Mac Pool 'SD2792', 4,500 %, fällig 01.03.2047	70	0,09
11 Fannie Mae Pool 'MA1253', 4,000 %, fällig 01.11.2042	11	0,01	77	Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, fällig 01.09.2051	68	0,09
16 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	16	0,02	242	Freddie Mac Pool 'SD3400', 4,500 %, fällig 01.10.2052	242	0,31
37 Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 01.07.2035	35	0,04	73	Freddie Mac Pool 'SD3432', 6,000 %, fällig 01.07.2053	76	0,10
62 Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 01.02.2036	60	0,08	142	Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, fällig 01.05.2053	145	0,19
44 Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 01.04.2036	43	0,05	76	Freddie Mac Pool 'SD5143', 6,000 %, fällig 01.04.2054	79	0,10
110 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01.07.2036	106	0,14	83	Freddie Mac Pool 'SD5691', 6,000 %, fällig 01.06.2054	85	0,11
72 Fannie Mae Pool 'MA2707', 3,000 %, fällig 01.08.2036	70	0,09	76	Freddie Mac Pool 'SD5709', 6,000 %, fällig 01.07.2054	79	0,10
18 Fannie Mae Pool 'MA4031', 4,500 %, fällig 01.05.2050	18	0,02	87	Freddie Mac Pool 'SD5876', 6,000 %, fällig 01.05.2054	91	0,12
47 Fannie Mae Pool 'MA4177', 2,500 %, fällig 01.11.2040	44	0,06	37	Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	34	0,04
935 Fannie Mae Pool 'MA4422', 2,000 %, fällig 01.09.2041	830	1,06	111	Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	99	0,13
5 Fannie Mae REMICS, Series 2001 81, Class GE, 6,000 %, fällig 25.01.2032	5	0,01	117	Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	104	0,13
13 Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Class ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	14	0,02	455	Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	403	0,51
102 Fannie Mae REMICS, Series 2012 118, Class VZ, 3,000 %, fällig 25.11.2042	96	0,12	33	Freddie Mac Pool 'ZA2489', 3,500 %, fällig 01.01.2038	32	0,04
4 Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Class BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	4	–	20	Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	19	0,02
6 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	6	0,01	10	Freddie Mac Pool 'ZN1436', 5,000 %, fällig 01.11.2048	11	0,01
7 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	7	0,01	3	Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	3	–
112 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	72	0,09	34	Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	32	0,04
263 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class DI, 2,500 %, fällig 25.08.2050	44	0,06	9	Freddie Mac REMICS 4194, Class BI, 3,500 %, fällig 15.04.2043	1	–
114 Fannie Mae REMICS, Series 2020 57, Class TA, 2,000 %, fällig 25.04.2050	102	0,13	–	Freddie Mac REMICS 4298, Class PI, 4,000 %, fällig 15.04.2043	–	–
258 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	44	0,06	25	Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	22	0,03
437 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	70	0,09	357	Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	83	0,11
384 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97, Class AI, 2,000 %, fällig 25.01.2051	50	0,06	113	Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	17	0,02
658 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class QI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	103	0,13	206	Freddie Mac REMICS 5010, Class JI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	35	0,04
58 Fannie Mae REMICS, Series 2021 65, Class JA, 2,000 %, fällig 25.01.2046	53	0,07	69	Freddie Mac REMICS 5013, Class IN, 2,500 %, fällig 25.09.2050	12	0,01
400 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	387	0,49	214	Freddie Mac REMICS 5018, Class MI, 2,000 %, fällig 25.10.2050	29	0,04
440 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,304 %, fällig 25.09.2034 *	24	0,03	323	Freddie Mac REMICS 5038, Class PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	242	0,31
3 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	3	–	57	Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	8	0,01
15 Freddie Mac Gold Pool 'Q17792', 3,500 %, fällig 01.05.2043	15	0,02	365	Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	61	0,08
31 Freddie Mac Gold Pool 'Q45560', 3,000 %, fällig 01.01.2047	29	0,04	63	Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	9	0,01
61 Freddie Mac Gold Pool 'Q45737', 3,000 %, fällig 01.01.2047	56	0,07	369	Freddie Mac REMICS 5085, Class NI, 2,000 %, fällig 25.03.2051	46	0,06
35 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01.01.2047	32	0,04	63	Freddie Mac REMICS 5092, Class AP, 2,000 %, fällig 25.04.2041	57	0,07
11 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	11	0,01	389	Freddie Mac REMICS 5093, Class IY, 4,500 %, fällig 25.12.2050	84	0,11
38 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	37	0,05	152	Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	22	0,03
2.865 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Class X1, 0,714 %, fällig 25.12.2030 *	83	0,11	200	Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	192	0,24

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)				58	Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,776 %, fällig 16.11.2047 *	54	0,07
81	Freddie Mac REMICS 5449, Class FQ, 5,167 %, fällig 25.09.2054 *	82	0,10	22	Government National Mortgage Association, Series 2013 H08, Class BF, 4,197 %, fällig 20.03.2063 *	22	0,03
83	Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 4,967 %, fällig 25.12.2054 *	84	0,11	10	Government National Mortgage Association, Series 2014 105, Class IO, 0,144 %, fällig 16.06.2054 *	–	–
420	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 6,567 %, fällig 25.04.2042 *	429	0,55	7	Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,535 %, fällig 16.06.2048 *	6	0,01
57	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates, Series T 56, Class 2AF, 4,182 %, fällig 25.05.2043 *	54	0,07	8	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,166 %, fällig 16.02.2048 *	–	–
9	Ginnie Mae I Pool '557522', 7,000 %, fällig 15.07.2031	10	0,01	43	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,587 %, fällig 16.09.2055 *	1	–
7	Ginnie Mae I Pool '565347', 7,000 %, fällig 15.08.2031	7	0,01	115	Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 4,227 %, fällig 20.10.2064 *	115	0,15
2	Ginnie Mae I Pool '584344', 7,000 %, fällig 15.04.2032	2	–	32	Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	6	0,01
49	Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	47	0,06	19	Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class MI, 5,500 %, fällig 20.03.2045	3	–
27	Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	26	0,03	429	Government National Mortgage Association, Series 2015 5, Class IK, 0,220 %, fällig 16.11.2054 *	2	–
41	Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	39	0,05	53	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class IL, 2,500 %, fällig 20.08.2050	8	0,01
88	Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	82	0,11	123	Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class NI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	18	0,02
4	Ginnie Mae II Pool '4837', 6,000 %, fällig 20.10.2040	4	0,01	60	Government National Mortgage Association, Series 2020 127, Class IN, 2,500 %, fällig 20.08.2050	9	0,01
5	Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20.01.2041	5	0,01	60	Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	9	0,01
3	Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	3	–	65	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	9	0,01
12	Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	12	0,01	63	Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	9	0,01
6	Ginnie Mae II Pool '5240', 6,000 %, fällig 20.11.2041	6	0,01	4.140	Government National Mortgage Association, Series 2020 178, Class IO, 1,422 %, fällig 16.10.2060 *	403	0,51
10	Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	10	0,01	4.233	Government National Mortgage Association, Series 2020 179, Class IO, 1,011 %, fällig 16.09.2062 *	302	0,39
328	Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20.07.2047	316	0,40	294	Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	33	0,04
8	Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	8	0,01	1.539	Government National Mortgage Association, Series 2020 195, Class IO, 0,925 %, fällig 16.12.2062 *	104	0,13
83	Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, fällig 20.02.2048	79	0,10	192	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	36	0,05
103	Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	94	0,12	111	Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	21	0,03
19	Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	18	0,02	83	Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class FP, 4,297 %, fällig 20.06.2069 *	83	0,11
44	Ginnie Mae II Pool '785359', 2,000 %, fällig 20.03.2051	38	0,05	218	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class FL, 4,947 %, fällig 20.05.2070 *	223	0,28
71	Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20.03.2051	60	0,08	47	Government National Mortgage Association, Series 2020 H09, Class NF, 5,047 %, fällig 20.04.2070 *	48	0,06
131	Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, fällig 20.08.2051	115	0,15	61	Government National Mortgage Association, Series 2020 H13, Class FA, 4,247 %, fällig 20.07.2070 *	61	0,08
65	Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500 %, fällig 20.10.2051	57	0,07	179	Government National Mortgage Association, Series 2021 115, Class MI, 2,500 %, fällig 20.05.2051	19	0,02
135	Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500 %, fällig 20.11.2051	119	0,15	333	Government National Mortgage Association, Series 2021 188, Class PA, 2,000 %, fällig 20.10.2051	280	0,36
207	Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500 %, fällig 20.12.2051	182	0,23	160	Government National Mortgage Association, Series 2021 2, Class AH, 1,500 %, fällig 16.06.2063	121	0,15
71	Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	65	0,08	70	Government National Mortgage Association, Series 2021 223, Class P, 2,000 %, fällig 20.06.2051	62	0,08
67	Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	62	0,08	4.498	Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,111 %, fällig 16.01.2061 *	364	0,46
83	Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	76	0,10	200	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class B, 1,850 %, fällig 16.02.2061	106	0,14
74	Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	75	0,10	830	Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	37	0,05
76	Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, fällig 20.05.2053	77	0,10	100	Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	88	0,11
80	Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, fällig 20.03.2051	67	0,09	295	Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	230	0,29
79	Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, fällig 20.08.2053	81	0,10	793	Government National Mortgage Association, Series 2025 175, Class LS, 2,288 %, fällig 20.10.2055 *	80	0,10
75	Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000 %, fällig 20.03.2052	69	0,09	923	Government National Mortgage Association, Series 2025 55, Class SD, 2,288 %, fällig 20.03.2055 *	71	0,09
232	Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, fällig 20.08.2053	238	0,30	176	HOMES 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,915 %, fällig 25.07.2069	178	0,23
285	Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, fällig 20.09.2053	295	0,38	53	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class AS, 4,202 %, fällig 15.09.2047 *	52	0,07
72	Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	75	0,10	240	MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042 *	241	0,31
81	Ginnie Mae II Pool '787276', 6,000 %, fällig 20.02.2054	84	0,11	160	MF1 2026-FL21 LLC, Series 2026 FL21, Class A, 144A, 5,014 %, fällig 18.02.2041 *	160	0,20
19	Ginnie Mae II Pool 'BC4732', 3,500 %, fällig 20.10.2047	18	0,02	131	Mill City Mortgage Trust 2015-2, Series 2015 2, Class M3, 144A, 3,681 %, fällig 25.09.2057 *	130	0,17
25	Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	23	0,03	59	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C30, Series 2016 C30, Class A4, 2,600 %, fällig 15.09.2049	59	0,08
50	Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	49	0,06	84	Morgan Stanley Capital I Trust 2017-ASHF, Series 2017 ASHF, Class A, 144A, 4,807 %, fällig 15.11.2034 *	83	0,11
26	Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	25	0,03				
90	Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	81	0,10				
21	Ginnie Mae II Pool 'MA1995', 3,500 %, fällig 20.06.2044	20	0,03				
8	Ginnie Mae II Pool 'MA2678', 3,500 %, fällig 20.03.2045	7	0,01				
81	Ginnie Mae II Pool 'MA3521', 3,500 %, fällig 20.03.2046	78	0,10				
43	Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	42	0,05				
11	Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	10	0,01				
34	Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	32	0,04				
16	Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	15	0,02				
9	Ginnie Mae II Pool 'MA4899', 3,000 %, fällig 20.12.2047	8	0,01				
14	Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, fällig 20.05.2048	15	0,02				
146	Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	147	0,19				
28	Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	29	0,04				
45	Ginnie Mae II Pool 'MA5529', 4,500 %, fällig 20.10.2048	46	0,06				
12	Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	12	0,02				
20	Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	20	0,03				
35	Ginnie Mae II Pool 'MA5653', 5,000 %, fällig 20.12.2048	36	0,05				
132	Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	133	0,17				
11	Ginnie Mae II Pool 'MA5712', 5,000 %, fällig 20.01.2049	12	0,01				
58	Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	59	0,08				
14	Ginnie Mae II Pool 'MA5878', 5,000 %, fällig 20.04.2049	15	0,02				
13	Ginnie Mae II Pool 'MA6287', 5,000 %, fällig 20.11.2049	13	0,02				
28	Ginnie Mae II Pool 'MA6413', 5,000 %, fällig 20.01.2050	28	0,04				
132	Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, fällig 20.11.2052	135	0,17				
200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	169	0,22				
200	Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	177	0,23				
2	Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 4,932 %, fällig 20.11.2059 *	2	–				
1	Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,147 %, fällig 20.08.2058 *	1	–				
4	Government National Mortgage Association, Series 2011 H01, Class AF, 4,247 %, fällig 20.11.2060 *	4	–				
7	Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 4,297 %, fällig 20.03.2061 *	7	0,01				
3	Government National Mortgage Association, Series 2012 H18, Class NA, 4,317 %, fällig 20.08.2062 *	3	–				
6	Government National Mortgage Association, Series 2012 H27, Class AI, 1,766 %, fällig 20.10.2062 *	–	–				
3	Government National Mortgage Association, Series 2012 H30, Class GA, 4,147 %, fällig 20.12.2062 *	3	–				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			Vereinigtes Königreich – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,40 %)		
103 New Residential Mortgage Loan Trust 2015-2, Series 2015 2A, Class A1, 144A, 3,750 %, fällig 25.08.2055 *	102	0,13	400 HSBC Holdings Plc, 4,041 %, fällig 13.03.2028 *	400	0,51
163 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	158	0,20	USA – 28,44 % (28. Februar 2025: 24,55 %)		
180 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	178	0,23	40 Abbott Laboratories, 4,000 %, fällig 15.03.2031	40	0,05
210 OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,928 %, fällig 25.11.2063	212	0,27	90 Abbott Laboratories, 4,300 %, fällig 15.03.2033	90	0,11
161 OBX 2024-NQM11 Trust, Series 2024 NQM11, Class A1, 144A, 5,875 %, fällig 25.06.2064	163	0,21	40 Abbott Laboratories, 4,650 %, fällig 15.03.2036	40	0,05
44 PFP 2024-11 Ltd, Series 2024 11, Class A, 144A, 5,501 %, fällig 17.09.2039 *	44	0,05	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,01
300 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,136 %, fällig 15.12.2051 *	290	0,37	20 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 15.03.2038	20	0,03
194 Verus Securitization Trust 2025-R2, Series 2025 R2, Class A2, 144A, 5,238 %, fällig 25.07.2067	196	0,25	50 Abbott Laboratories, 5,500 %, fällig 15.03.2056	50	0,06
269 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A3, 2,807 %, fällig 15.11.2059	267	0,34	120 AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	123	0,16
150 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class A4, 3,065 %, fällig 15.11.2059	149	0,19	390 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	381	0,49
1.256 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2016-C36, Series 2016 C36, Class XA, 1,135 %, fällig 15.11.2059 *	3	–	50 AbbVie Inc, 4,950 %, fällig 15.03.2031	52	0,07
460 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C41, Series 2017 C41, Class B, 4,188 %, fällig 15.11.2050 *	444	0,57	70 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	73	0,09
18 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C23, Series 2014 C23, Class XA, 0,068 %, fällig 15.10.2057 *†	–	–	10 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	9	0,01
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 29.707 \$)	29.852	38,12	50 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	51	0,07
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 34,16 % (28. Februar 2025: 30,84 %)			40 Alphabet Inc, 3,700 %, fällig 15.02.2029	40	0,05
Belgien – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,14 %)			20 Alphabet Inc, 4,100 %, fällig 15.02.2031	20	0,03
60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	59	0,07	10 Alphabet Inc, 4,400 %, fällig 15.02.2033	10	0,01
60 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,439 %, fällig 06.10.2048	53	0,07	20 Alphabet Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2035	20	0,03
30 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 5,550 %, fällig 23.01.2049	30	0,04	50 Alphabet Inc, 4,700 %, fällig 15.11.2035	51	0,06
	142	0,18	30 Alphabet Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	30	0,04
Brasilien – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,25 %)			10 Alphabet Inc, 5,350 %, fällig 15.11.2045	10	0,01
50 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	48	0,06	40 Alphabet Inc, 5,500 %, fällig 15.02.2046	41	0,05
Kanada – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,18 %)			30 Alphabet Inc, 5,250 %, fällig 15.05.2055	29	0,04
10 Barrick PD Australia Finance Pty Ltd, 5,950 %, fällig 15.10.2039	11	0,01	40 Alphabet Inc, 5,650 %, fällig 15.02.2056	41	0,05
20 Royal Bank of Canada, 3,875 %, fällig 04.05.2032	19	0,03	30 Alphabet Inc, 5,300 %, fällig 15.05.2065	28	0,04
	30	0,04	60 Amazon.com Inc, 3,450 %, fällig 13.04.2029	60	0,08
China – 0,25 % (28. Februar 2025: 0,37 %)			50 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	45	0,06
210 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	194	0,25	50 Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig 20.11.2030	50	0,06
Kolumbien – 0,19 % (28. Februar 2025: 0,26 %)			80 Amazon.com Inc, 4,950 %, fällig 05.12.2044	78	0,10
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	151	0,19	190 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	115	0,15
Frankreich – 0,55 % (28. Februar 2025: 0,63 %)			20 American International Group Inc, 4,750 %, fällig 01.04.2048	18	0,02
210 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	214	0,27	30 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	27	0,04
200 BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, fällig 05.12.2034 *	215	0,28	11 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	10	0,01
	429	0,55	30 Amrize Finance US LLC, 5,400 %, fällig 07.04.2035	31	0,04
Indien – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,20 %)			40 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	42	0,05
270 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12.01.2052	203	0,26	40 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	36	0,05
Irland – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,57 %)			50 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	43	0,06
230 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	228	0,29	10 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	10	0,01
Japan – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			10 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	10	0,01
200 NTT Finance Corp, 144A, 4,876 %, fällig 16.07.2030	205	0,26	37 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	31	0,04
Kasachstan – 0,47 % (28. Februar 2025: 0,36 %)			28 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	24	0,03
360 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	371	0,47	90 AT&T Inc, 3,500 %, fällig 15.09.2053	61	0,08
Mexiko – 0,46 % (28. Februar 2025: 0,70 %)			76 AT&T Inc, 3,550 %, fällig 15.09.2055	52	0,07
400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 3,875 %, fällig 26.07.2033	358	0,46	10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	0,01
Spanien – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			63 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	42	0,05
200 Banco Santander SA, 4,551 %, fällig 06.11.2030	202	0,26	10 Bank of America Corp, 4,450 %, fällig 03.03.2026	10	0,01
Schweiz – 1,11 % (28. Februar 2025: 0,86 %)			193 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	191	0,24
400 UBS Group AG, 144A, 3,126 %, fällig 13.08.2030 *	387	0,49	220 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	220	0,28
250 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	249	0,32	200 Bank of America Corp, 3,974 %, fällig 07.02.2030 *	200	0,26
250 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	234	0,30	120 Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	113	0,14
	870	1,11	130 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	118	0,15
Taiwan – 0,67 % (28. Februar 2025: 0,51 %)			630 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	583	0,74
570 TSMC Arizona Corp, 2,500 %, fällig 25.10.2031	528	0,67	130 Bank of America Corp, 3,946 %, fällig 23.01.2049 *	105	0,13
Vereinigte Arabische Emirate – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,44 %)			40 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	32	0,04
110 DP World Ltd/United Arab Emirates, 6,850 %, fällig 02.07.2037	124	0,16	70 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	59	0,08
			360 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	351	0,45
			100 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	99	0,13
			60 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	63	0,08
			60 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	63	0,08
			80 Broadcom Inc, 4,600 %, fällig 15.01.2033	81	0,10
			200 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	175	0,22
			40 Broadcom Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	40	0,05
			430 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	384	0,49
			50 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	55	0,07
			310 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	310	0,40
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	81	0,10
			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,400 %, fällig 01.04.2033	76	0,10
			30 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,550 %, fällig 01.06.2034	32	0,04
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	83	0,11
			90 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	86	0,11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	8	0,01	80 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	76	0,10
120 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	105	0,13	30 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	29	0,04
180 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	182	0,23	130 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	108	0,14
70 Citigroup Inc, 4,658 %, fällig 24.05.2028 *	71	0,09	20 Home Depot Inc/The, 3,900 %, fällig 15.06.2047	16	0,02
220 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	221	0,28	60 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	43	0,05
50 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	47	0,06	50 Howmet Aerospace Inc, 4,550 %, fällig 15.11.2032	51	0,07
390 Citigroup Inc, 3,785 %, fällig 17.03.2033 *	375	0,48	20 Humana Inc, 3,950 %, fällig 15.03.2027	20	0,03
70 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	71	0,09	110 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	108	0,14
37 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	34	0,04	50 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	52	0,07
70 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	76	0,10	110 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	92	0,12
60 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	59	0,08	20 Intel Corp, 3,050 %, fällig 12.08.2051	13	0,02
191 Comcast Corp, 7,050 %, fällig 15.03.2033	221	0,28	130 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	131	0,17
20 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	20	0,03	110 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	111	0,14
30 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	24	0,03	210 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	197	0,25
50 Continental Resources Inc/OK, 4,375 %, fällig 15.01.2028	50	0,06	150 JPMorgan Chase & Co, 2,580 %, fällig 22.04.2032 *	138	0,18
170 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	170	0,22	90 JPMorgan Chase & Co, 5,576 %, fällig 23.07.2036 *	94	0,12
140 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	142	0,18	50 JPMorgan Chase & Co, 3,109 %, fällig 22.04.2051 *	34	0,04
40 CVS Health Corp, 3,625 %, fällig 01.04.2027	40	0,05	20 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	21	0,03
70 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	70	0,09	100 KLA Corp, 4,650 %, fällig 15.07.2032	103	0,13
190 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	187	0,24	60 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	61	0,08
20 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	18	0,02	110 Las Vegas Sands Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2028	113	0,14
60 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	53	0,07	40 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	42	0,05
320 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	306	0,39	20 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 14.06.2030	21	0,03
17 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	15	0,02	30 Lowe's Cos Inc, 4,500 %, fällig 15.04.2030	31	0,04
55 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	55	0,07	180 Mastercard Inc, 3,850 %, fällig 26.03.2050	143	0,18
18 Devon Energy Corp, 5,250 %, fällig 15.10.2027	18	0,02	60 McDonald's Corp, 2,125 %, fällig 01.03.2030	56	0,07
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	40	0,05	80 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	79	0,10
10 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	9	0,01	10 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	8	0,01
50 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	49	0,06	140 Meta Platforms Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	142	0,18
30 Diamondback Energy Inc, 3,125 %, fällig 01.04.2031	28	0,04	40 Meta Platforms Inc, 4,875 %, fällig 15.11.2035	40	0,05
10 Discovery Global Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	10	0,01	60 Meta Platforms Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2045	59	0,08
30 Discovery Global Holdings Inc, 4,054 %, fällig 15.03.2029	30	0,04	50 Meta Platforms Inc, 5,625 %, fällig 15.11.2055	49	0,06
60 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	59	0,08	80 Meta Platforms Inc, 5,750 %, fällig 15.11.2065	78	0,10
160 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	164	0,21	195 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	204	0,26
50 Eli Lilly & Co, 4,600 %, fällig 14.08.2034	51	0,07	80 Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig 15.01.2031	84	0,11
20 Eli Lilly & Co, 5,000 %, fällig 09.02.2054	19	0,02	50 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	54	0,07
140 Eli Lilly & Co, 5,100 %, fällig 09.02.2064	131	0,17	150 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	100	0,13
180 Enterprise Products Operating LLC, 4,150 %, fällig 16.10.2028	182	0,23	20 Mid-Atlantic Interstate Transmission LLC, 144A, 4,100 %, fällig 15.05.2028	20	0,03
170 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 31.01.2034	174	0,22	200 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,370 %, fällig 15.04.2029	199	0,25
20 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 15.03.2044	19	0,02	100 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	95	0,12
30 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	30	0,04	480 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	469	0,60
40 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	41	0,05	60 Morgan Stanley, 4,493 %, fällig 16.01.2032 *	60	0,08
140 EQT Corp, 7,000 %, fällig 01.02.2030	153	0,20	110 MPLX LP, 4,000 %, fällig 15.03.2028	110	0,14
100 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	100	0,13	30 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	28	0,04
40 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,300 %, fällig 15.03.2029	40	0,05	20 MPLX LP, 4,700 %, fällig 15.04.2048	17	0,02
30 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,650 %, fällig 15.03.2031	30	0,04	60 NIKE Inc, 3,250 %, fällig 27.03.2040	49	0,06
20 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,950 %, fällig 15.03.2033	20	0,03	20 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 01.04.2035	21	0,03
180 FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	181	0,23	20 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,800 %, fällig 01.04.2055	21	0,03
90 FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	80	0,10	30 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	32	0,04
50 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	51	0,07	20 ONEOK Inc, 6,625 %, fällig 01.09.2053	21	0,03
40 Ford Motor Co, 6,100 %, fällig 19.08.2032	42	0,05	50 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	50	0,06
30 GE Vernova Inc, 4,250 %, fällig 04.02.2031	30	0,04	10 Oracle Corp, 4,950 %, fällig 04.02.2031	10	0,01
30 GE Vernova Inc, 4,875 %, fällig 04.02.2036	30	0,04	230 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	209	0,27
10 GE Vernova Inc, 5,500 %, fällig 04.02.2056	10	0,01	10 Oracle Corp, 4,800 %, fällig 26.09.2032	10	0,01
70 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	74	0,09	10 Oracle Corp, 5,350 %, fällig 04.05.2033	10	0,01
10 General Motors Co, 6,600 %, fällig 01.04.2036	11	0,01	20 Oracle Corp, 5,200 %, fällig 26.09.2035	19	0,02
10 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	10	0,01	10 Oracle Corp, 5,700 %, fällig 04.02.2036	10	0,01
90 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,500 %, fällig 16.11.2026	90	0,11	40 Oracle Corp, 5,875 %, fällig 26.09.2045	36	0,05
40 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	40	0,05	60 Oracle Corp, 5,375 %, fällig 27.09.2054	49	0,06
630 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	632	0,81	20 Oracle Corp, 5,950 %, fällig 26.09.2055	18	0,02
140 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,516 %, fällig 21.01.2032 *	141	0,18	20 Oracle Corp, 6,850 %, fällig 04.02.2066	19	0,02
30 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	33	0,04	50 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	49	0,06
10 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	9	0,01	50 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	46	0,06
			10 Pacific Gas and Electric Co, 5,050 %, fällig am 15.10.2032	10	0,01
			20 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.08.2040	16	0,02
			30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	21	0,03
			250 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	238	0,30
			90 Pfizer Inc, 1,700 %, fällig 28.05.2030	82	0,11
			150 Pfizer Inc, 2,550 %, fällig 28.05.2040	113	0,14
			80 Pfizer Inc, 2,700 %, fällig 28.05.2050	51	0,07
			20 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	18	0,02
			230 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	212	0,27
			70 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	73	0,09
			310 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	274	0,35
			50 QUALCOMM Inc, 5,000 %, fällig 20.05.2035	51	0,07
			60 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 30.09.2031	62	0,08
			70 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	73	0,09
			40 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,750 %, fällig 15.05.2033	40	0,05
			10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 27.02.2038	10	0,01
			110 Shell Finance US Inc, 2,750 %, fällig 06.04.2030	105	0,13

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
51 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	53	0,07	40 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2027	40	0,05
130 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	136	0,17	3.060 United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 31.12.2027	3.059	3,91
127 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	127	0,16	10 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.01.2028	10	0,01
110 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	129	0,16	10 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.06.2028	10	0,01
30 Synopsys Inc, 4,850 %, fällig 01.04.2030	31	0,04	90 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.12.2029	93	0,12
20 Synopsys Inc, 5,000 %, fällig 01.04.2032	21	0,03	120 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	122	0,16
20 Synopsys Inc, 5,150 %, fällig 01.04.2035	20	0,03	270 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.07.2030	274	0,35
40 Synopsys Inc, 5,700 %, fällig 01.04.2055	40	0,05	150 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.11.2030	150	0,19
30 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	26	0,03	30 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	30	0,04
230 Tennessee Gas Pipeline Co LLC, 144A, 2,900 %, fällig 01.03.2030	220	0,28	280 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.05.2035	287	0,37
70 Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030	64	0,08	230 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	236	0,30
30 Time Warner Cable LLC, 6,550 %, fällig 01.05.2037	31	0,04	30 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2044	27	0,03
30 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	28	0,04	120 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.02.2045	123	0,16
20 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	20	0,03	10 United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 15.05.2045	10	0,01
280 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	278	0,36	540 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 15.08.2045	562	0,72
50 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	46	0,06	170 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2048	131	0,17
80 T-Mobile USA Inc, 2,250 %, fällig 15.11.2031	72	0,09	320 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	245	0,31
70 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	72	0,09	130 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	97	0,12
110 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	84	0,11	3.200 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	1.958	2,50
30 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	20	0,03	50 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	26	0,03
60 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,250 %, fällig 15.05.2030	58	0,07	700 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	384	0,49
190 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 3,950 %, fällig 15.05.2050	150	0,19	520 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	341	0,44
20 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	20	0,03	230 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	146	0,19
130 Union Pacific Corp, 2,400 %, fällig 05.02.2030	123	0,16	10 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2055	10	0,01
110 Union Pacific Corp, 3,750 %, fällig 05.02.2070	77	0,10	20 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	20	0,03
30 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.12.2028	30	0,04	140 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055	143	0,18
20 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	18	0,02		9.632	12,30
50 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	50	0,06	Uruguay – 0,34 % (28. Februar 2025: 0,27 %)		
120 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	91	0,12	220 Uruguay, Internationale Staatsanleihe, 7,625 %, fällig 21.03.2036	268	0,34
50 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.03.2043	43	0,06	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 13.130 \$)		
40 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	33	0,04		11.197	14,30
20 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	17	0,02	Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,38 % (28. Februar 2025: 4,13 %)		
50 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	38	0,05	2.644 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2.644	3,38
60 UnitedHealth Group Inc, 2,900 %, fällig 15.05.2050	39	0,05	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.644 \$)		
20 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	15	0,02		2.644	3,38
20 UnitedHealth Group Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2060	12	0,02	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 80.607 \$)		
10 US Bancorp, Series mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	10	0,01		78.279	99,97
100 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	104	0,13	Kontrakte (in Tsd.)		
90 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	97	0,12		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
150 USAA Capital Corp, 144A, 2,125 %, fällig 01.05.2030	140	0,18	Gekaufte Optionen – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,30 %)		
70 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	68	0,09	– CME 3 Month SOFR Futures Juni 2026 Call 96.75, fällig 12.06.2026 – Goldman Sachs	6	0,01
270 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	269	0,34	– U.S. 5 Year W1 März 2026 Call 109.75, fällig 06.03.2026 – Goldman Sachs	6	0,01
60 Verizon Communications Inc, 4,400 %, fällig 01.11.2034	59	0,08	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 40 \$)		
64 Verizon Communications Inc, 4,780 %, fällig 15.02.2035	64	0,08		12	0,02
20 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	20	0,03	Credit Default Swaps – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,21 %)		
210 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	153	0,20	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	61	0,08
30 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	24	0,03	Swaptions – 0,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
10 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	9	0,01	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	40	0,05
80 Verizon Communications Inc, 4,000 %, fällig 22.03.2050	63	0,08	Futures – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,22 %)		
70 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 23.02.2054	68	0,09	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	105	0,13
30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,03	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
50 Visa Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2047	40	0,05		78.497 \$	100,25
70 Vistra Operations Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 31.01.2036	71	0,09			
100 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	103	0,13			
30 Wells Fargo & Co, 5,574 %, fällig 25.07.2029 *	31	0,04			
130 Wells Fargo & Co, 2,879 %, fällig 30.10.2030 *	124	0,16			
120 Wells Fargo & Co, 4,478 %, fällig 04.04.2031 *	121	0,16			
220 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	207	0,26			
180 Wells Fargo & Co, 4,400 %, fällig 14.06.2046	152	0,19			
750 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	687	0,88			
150 Williams Cos Inc/The, 5,150 %, fällig 15.03.2034	154	0,20			
	22.266	28,44			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.356 \$)					
	26.749	34,16			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 14,30 % (28. Februar 2025: 9,87 %)					
Chile – 0,21 % (28. Februar 2025: 0,16 %)					
250 Internationale Staatsanleihe Chile, 3,100 %, fällig 22.01.2061	163	0,21			
Mexiko – 0,68 % (28. Februar 2025: 0,64 %)					
610 Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 12.02.2034	534	0,68			
Peru – 0,77 % (28. Februar 2025: 0,27 %)					
580 Peru, Internationale Staatsanleihe, 5,375 %, fällig 08.02.2035	600	0,77			
USA – 12,30 % (28. Februar 2025: 7,07 %)					
530 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034 β	563	0,72			
500 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,125 %, fällig 15.01.2035 β	535	0,68			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Verkaufte Optionen – -0,01 % (28. Februar 2025: -0,16 %)			
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Call 97,50, fällig 11.12.2026 – Goldman Sachs	-3	-0,01	
– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Put 96,50, fällig 11.12.2026 – Goldman Sachs	-2	–	
– CME 3 Month SOFR Futures September 2026 Call 97,50, fällig 11.09.2026 – Goldman Sachs	-2	–	
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -15 \$)	-7	-0,01	
Index-Swaps – -0,05 % (28. Februar 2025: -0,19 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-42	-0,05	
Inflationsswaps – -0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-18	-0,02	
Swaptions – -0,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-36	-0,05	
Futures – -0,02 % (28. Februar 2025: -0,02 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-17	-0,02	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-120	-0,15	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	78.377	100,10	
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-75	-0,10	
Gesamtnettovermögen	78.302 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 14.595.000 \$ und machten 18,65 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.
- † Nicht liquide.
- ± 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 2026.

ABKÜRZUNGEN:

- 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	94,83
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,31
Finanzderivate	0,27
Sonstige Vermögenswerte	1,59
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2035	2.037	\$ 8
Goldman Sachs	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	2.740	53
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 207 \$)				\$ 61
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 207 \$)				\$ 61

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,320 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR OIS Compound	15. Dez. 2027	13.334	\$ -22
Goldman Sachs	Zahlt festen Zinssatz von 3,420 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR OIS Compound	31. Aug. 2032	3.411	-20
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 52 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -190 \$)				-42
Nettowertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -138 \$)				\$ -42

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	USD – CPI Urban Consumers	21. Nov. 2030	3.530	\$ -18
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-18
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ -18

Aufstellung von Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	26. Sep. 2026	570	\$ 2
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	2.530	-36
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	10.820	38
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 40
Nicht realisierte Wertminderung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-36
Nettowertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Goldman Sachs	18	\$ 4.334	\$ 3
3 Month SOFR Index März 2026	Goldman Sachs	35	8.431	-13
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	54	6.146	39
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Goldman Sachs	13	1.517	9
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	36	7.534	12
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	61	6.719	27
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	13	1.540	15
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	-2	-243	-4
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 212 \$)				\$ 105
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -20 \$)				-17
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 192 \$)				\$ 88

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 9,87 % (28. Februar 2025: 6,70 %)					
300	Abry Liquid Credit CLO 2025-2 Ltd, Series 2025 2A, Class A1, 144A, 4,995 %, fällig 15.01.2038 *	301	0,17		
500	Aimco CLO 15 Ltd, Series 2021 15A, Class AR, 144A, 4,868 %, fällig 17.04.2038 *	501	0,28		
310	Antares CLO 2018-1 Ltd, Series 2018 1A, Class A1R, 144A, 5,038 %, fällig 20.04.2038 *	310	0,18		
440	Apex Credit CLO 2021-II LLC, Series 2021 2A, Class A1AR, 144A, 4,848 %, fällig 20.10.2034 *	441	0,25		
570	Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class A1R, 144A, 4,918 %, fällig 25.10.2038 *	571	0,32		
290	Atlas Senior Loan Fund XXVI Ltd, Series 2025 26A, Class AN, 144A, 5,208 %, fällig 22.10.2038 *	291	0,17		
110	Atlas Senior Loan Fund XXVI Ltd, Series 2025 26A, Class AY, 144A, 5,198 %, fällig 22.10.2038 *	110	0,06		
500	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2025 4A, Class A, 144A, 4,400 %, fällig 20.02.2032	505	0,28		
300	Bayswater Park CLO Ltd, Series 2023 1A, Class AR, 144A, 4,878 %, fällig 20.01.2039 *	300	0,17		
1.380	CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class A1, 144A, 5,058 %, fällig 20.10.2037 *	1.384	0,78		
530	Castlelake Aircraft Structured Trust 2026-1, Series 2026 1A, Class A, 144A, 5,073 %, fällig 15.03.2051	534	0,30		
823	DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	750	0,42		
127	Freddie Mac Structured Pass-Through Certificates FRESR 2017-SR01, Series 2017 SR01, Class A3, 3,089 %, fällig 25.11.2027	125	0,07		
455	GGAM Master Trust International Ltd, Series 2025 1A, Class A, 144A, 5,923 %, fällig 30.09.2060	467	0,27		
2.340	Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class A1, 144A, 5,038 %, fällig 25.10.2037 *	2.346	1,33		
796	Long Beach Mortgage Loan Trust 2004-1, Series 2004 1, Class M1, 4,538 %, fällig 25.02.2034 *	793	0,45		
480	Obra CLO 2 Ltd, Series 2025 2A, Class A1, 144A, 5,208 %, fällig 20.07.2038 *	482	0,27		
390	Park Blue CLO 2022-II Ltd, Series 2022 2A, Class A1R, 144A, 5,088 %, fällig 20.07.2037 *	391	0,22		
520	Polus US CLO II Ltd, Series 2025 2A, Class A1, 144A, 5,188 %, fällig 20.07.2038 *	523	0,30		
410	Silver Point CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class A1, 144A, 4,882 %, fällig 15.04.2038 *	410	0,23		
2	SMB Private Education Loan Trust 2015-A, Series 2015 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 15.10.2048	383	0,22		
1.299	SMB Private Education Loan Trust 2024-A, Series 2024 A, Class A1A, 144A, 5,240 %, fällig 15.03.2056	1.346	0,76		
162	SMB Private Education Loan Trust, Series 2020 B, Class A1A, 144A, 1,290 %, fällig 15.07.2053	156	0,09		
855	Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class A, 144A, 2,675 %, fällig 28.02.2033	835	0,47		
395	Subway Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2I, 144A, 6,028 %, fällig 30.07.2054	400	0,23		
1.373	Subway Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2II, 144A, 6,268 %, fällig 30.07.2054	1.408	0,80		
380	Sycamore Tree CLO 2025-6 Ltd, Series 2025 6A, Class A1, 144A, 4,868 %, fällig 20.04.2038 *	381	0,22		
320	Trinitas CLO XVI Ltd, Series 2021 16A, Class A1R, 144A, 4,798 %, fällig 20.07.2038 *	320	0,18		
430	Trinitas CLO XXXII Ltd, Series 2025 32A, Class A1, 144A, 5,001 %, fällig 23.07.2038 *	431	0,24		
248	Venture 38 CLO Ltd, Series 2019 38A, Class ARR, 144A, 4,667 %, fällig 30.07.2032 *	249	0,14		
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 18.663 \$)			17.444	9,87	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 42,13 % (28. Februar 2025: 44,55 %)					
1.000	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class A, 144A, 4,849 %, fällig 15.09.2034 *	996	0,56		
35	Alternative Loan Trust 2006-18CB, Series 2006 18CB, Class A6, 13,447 %, fällig 25.07.2036 *	37	0,02		
546	AREIT 2022-CRE7 LLC, Series 2022 CRE7, Class A, 144A, 5,906 %, fällig 17.06.2039 *	546	0,31		
1.630	Banc of America Funding 2014-R2 Trust, Series 2014 R2, Class 2A2, 144A, 4,001 %, fällig 26.05.2037 *	1.463	0,83		
1.790	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	1.772	1,00		
10.880	BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class XA, 0,661 %, fällig 15.09.2060 *	80	0,05		
1.030	BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	1.024	0,58		
1.500	BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,654 %, fällig 15.11.2061 *	1.425	0,81		
773	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A1, 144A, 5,803 %, fällig 25.06.2064	781	0,44		
250	BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Series 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041 *	246	0,14		
37	CHL Mortgage Pass-Through Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 1A2, 4,368 %, fällig 25.04.2035 *	36	0,02		
530	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, Series 2016 C1, Class A4, 3,209 %, fällig 10.05.2049	529	0,30		
62.299	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,885 %, fällig 15.11.2049 *	131	0,07		
747	COLT 2024-3 Mortgage Loan Trust, Series 2024 3, Class A2, 144A, 6,646 %, fällig 25.06.2069	758	0,43		
90	COMM 2015-DC1 Mortgage Trust, Series 2015 DC1, Class B, 4,035 %, fällig 10.02.2048 *	86	0,05		
361	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 7,882 %, fällig 25.07.2039 *	365	0,21		
840	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R08, Series 2023 R08, Class 1M2, 144A, 6,167 %, fällig 25.10.2043 *	856	0,48		
710	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R02, Series 2024 R02, Class 1M2, 144A, 5,467 %, fällig 25.02.2044 *	715	0,40		
1.960	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class M2, 144A, 2,983 %, fällig 25.07.2057 *	1.581	0,89		
115	Deutsche Mortgage Securities Inc Mortgage Loan Trust Series 2006-PR1, Series 2006 PR1, Class 3AF1, 144A, 4,054 %, fällig 15.04.2036 *	107	0,06		
40	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C18, 4,000 %, fällig 25.04.2042	7	–		
39	Fannie Mae Interest Strip 409, Class C22, 4,500 %, fällig 25.11.2039	6	–		
506	Fannie Mae Interest Strip 427, Class C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	81	0,05		
1.900	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	1.647	0,93		
2.900	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	2.623	1,48		
800	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	754	0,43		
1.000	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	989	0,56		
1.900	Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	1.909	1,08		
3	Fannie Mae Pool '843997', 5,783 %, fällig 01.11.2035 *	3	–		
3	Fannie Mae Pool '865915', 5,997 %, fällig 01.03.2036 *	3	–		
10	Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01.08.2038	11	0,01		
162	Fannie Mae Pool 'AP4781', 3,000 %, fällig 01.09.2042	152	0,09		
182	Fannie Mae Pool 'BD8104', 3,000 %, fällig 01.10.2046	169	0,10		
639	Fannie Mae Pool 'BF0104', 4,000 %, fällig 01.02.2056	624	0,35		
368	Fannie Mae Pool 'BF0183', 4,000 %, fällig 01.01.2057	359	0,20		
28	Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01.08.2058	28	0,02		
208	Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	205	0,12		
51	Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	49	0,03		
528	Fannie Mae Pool 'BM1565', 3,000 %, fällig 01.04.2047	492	0,28		
31	Fannie Mae Pool 'BM3799', 3,000 %, fällig 01.08.2047	28	0,02		
216	Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 01.11.2048	218	0,12		
706	Fannie Mae Pool 'BN3898', 4,500 %, fällig 01.12.2048	710	0,40		
162	Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	138	0,08		
288	Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	241	0,14		
1.244	Fannie Mae Pool 'CA7240', 2,500 %, fällig 01.10.2050	1.102	0,62		
659	Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 01.03.2052	582	0,33		
70	Fannie Mae Pool 'CB4103', 5,000 %, fällig 01.07.2052	72	0,04		
194	Fannie Mae Pool 'FA2766', 6,000 %, fällig 01.09.2055	202	0,11		
736	Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	754	0,43		
637	Fannie Mae Pool 'FM3123', 2,500 %, fällig 01.03.2038	603	0,34		
137	Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01.11.2048	135	0,08		
145	Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 01.02.2051	128	0,07		
178	Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	158	0,09		
70	Fannie Mae Pool 'FM6015', 3,500 %, fällig 01.08.2039	68	0,04		
1.989	Fannie Mae Pool 'FM6597', 2,000 %, fällig 01.03.2041	1.782	1,01		
60	Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 01.06.2051	53	0,03		
94	Fannie Mae Pool 'FM7796', 4,000 %, fällig 01.06.2048	93	0,05		
267	Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 01.07.2051	238	0,13		
74	Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 01.04.2052	65	0,04		
71	Fannie Mae Pool 'FS1726', 2,000 %, fällig 01.09.2041	64	0,04		
1.326	Fannie Mae Pool 'FS2023', 4,000 %, fällig 01.05.2052	1.302	0,74		
316	Fannie Mae Pool 'FS3672', 5,500 %, fällig 01.02.2053	325	0,18		
324	Fannie Mae Pool 'FS5306', 6,000 %, fällig 01.07.2053	336	0,19		
2.209	Fannie Mae Pool 'FS5313', 3,500 %, fällig 01.01.2050	2.110	1,19		
1.181	Fannie Mae Pool 'FS7236', 2,000 %, fällig 01.03.2052	1.000	0,57		
474	Fannie Mae Pool 'FS7997', 6,000 %, fällig 01.05.2054	487	0,28		
600	Fannie Mae Pool 'FS8124', 3,000 %, fällig 01.06.2052	550	0,31		
4	Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	4	–		
18	Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	19	0,01		
6	Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	6	–		
8	Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	8	–		
9	Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	9	–		
37	Fannie Mae Pool 'MA2320', 3,000 %, fällig 01.07.2035	35	0,02		
360	Fannie Mae Pool 'MA2523', 3,000 %, fällig 01.02.2036	348	0,20		
266	Fannie Mae Pool 'MA2579', 3,000 %, fällig 01.04.2036	257	0,15		
27	Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01.07.2036	27	0,01		
52	Fannie Mae REMICS, Series 2005 29, Class ZA, 5,500 %, fällig 25.04.2035	55	0,03		
26	Fannie Mae REMICS, Series 2012 46, Class BA, 6,000 %, fällig 25.05.2042	28	0,02		
39	Fannie Mae REMICS, Series 2012 51, Class B, 7,000 %, fällig 25.05.2042	43	0,02		
102	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	110	0,06		
110	Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	114	0,06		

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
1.672 Fannie Mae REMICS, Series 2020 56, Class AQ, 2,000 %, fällig 25.08.2050	1.388	0,79	362 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	329	0,19
1.811 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	290	0,16	56 Ginnie Mae II Pool '784985', 3,500 %, fällig 20.09.2048	54	0,03
85 Fannie Mae REMICS, Series 2025 53, Class FA, 5,597 %, fällig 25.07.2055 *	86	0,05	503 Ginnie Mae II Pool '785532', 3,000 %, fällig 20.06.2051	457	0,26
800 Fannie Mae-Aces, Series 2018 M15, Class 1A2, 3,700 %, fällig 25.01.2036	774	0,44	613 Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500 %, fällig 20.06.2051	538	0,30
1.393 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M36, Class X1, 1,304 %, fällig 25.09.2034 *	78	0,04	786 Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, fällig 20.08.2051	691	0,39
100 Fannie Mae-Aces, Series 2023 M4, Class A2, 3,767 %, fällig 25.09.2032 *	99	0,06	714 Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, fällig 20.09.2052	709	0,40
44 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01.04.2038	43	0,02	613 Ginnie Mae II Pool '786366', 4,500 %, fällig 20.08.2052	608	0,34
605 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	564	0,32	516 Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	522	0,30
173 Freddie Mac Gold Pool 'Q45819', 3,000 %, fällig 01.01.2047	161	0,09	228 Ginnie Mae II Pool '786709', 5,000 %, fällig 20.05.2053	231	0,13
6.039 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K058, Class X1, 0,892 %, fällig 25.08.2026 *	13	0,01	400 Ginnie Mae II Pool '786726', 2,000 %, fällig 20.03.2051	334	0,19
8.953 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K128, Class X1, 0,509 %, fällig 25.03.2031 *	189	0,11	78 Ginnie Mae II Pool '786823', 5,500 %, fällig 20.07.2053	79	0,04
4.865 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K131, Class X1, 0,725 %, fällig 25.07.2031 *	163	0,09	395 Ginnie Mae II Pool '786835', 5,500 %, fällig 20.08.2053	404	0,23
7.748 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K144, Class X1, 0,326 %, fällig 25.04.2032 *	151	0,09	87 Ginnie Mae II Pool '787259', 2,000 %, fällig 20.02.2051	73	0,04
39 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 3,615 %, fällig 01.03.2047 *	38	0,02	693 Ginnie Mae II Pool 'AP6338', 4,000 %, fällig 20.10.2045	679	0,38
315 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 5,156 %, fällig 01.11.2047 *	327	0,18	64 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20.10.2049	62	0,04
37 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	34	0,02	50 Ginnie Mae II Pool 'BM9743', 4,000 %, fällig 20.11.2049	49	0,03
166 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 01.02.2051	139	0,08	52 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	51	0,03
220 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	186	0,11	269 Ginnie Mae II Pool 'BT0812', 3,000 %, fällig 20.03.2050	244	0,14
109 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 01.02.2051	93	0,05	85 Ginnie Mae II Pool 'CI1513', 3,000 %, fällig 20.03.2052	76	0,04
64 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 01.05.2051	57	0,03	1.800 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	1.525	0,86
324 Freddie Mac Pool 'QC6551', 2,500 %, fällig 01.09.2051	287	0,16	1.400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	1.236	0,70
58 Freddie Mac Pool 'QK0701', 2,500 %, fällig 01.04.2041	53	0,03	100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	94	0,05
403 Freddie Mac Pool 'RA6562', 2,500 %, fällig 01.01.2052	359	0,20	100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	96	0,05
131 Freddie Mac Pool 'RA9079', 6,500 %, fällig 01.05.2053	139	0,08	500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	502	0,28
111 Freddie Mac Pool 'RA9080', 6,500 %, fällig 01.05.2053	118	0,07	37 Government National Mortgage Association, Series 2009 H01, Class FA, 4,932 %, fällig 20.11.2059 *	38	0,02
50 Freddie Mac Pool 'RB5071', 2,000 %, fällig 01.09.2040	45	0,03	90 Government National Mortgage Association, Series 2010 H11, Class FA, 4,786 %, fällig 20.06.2060 *	91	0,05
912 Freddie Mac Pool 'RB5084', 1,500 %, fällig 01.11.2040	793	0,45	56 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 4,127 %, fällig 20.10.2060 *	56	0,03
769 Freddie Mac Pool 'SC0160', 2,000 %, fällig 01.07.2041	688	0,39	– Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 4,147 %, fällig 20.05.2059 *	–	–
257 Freddie Mac Pool 'SC0188', 2,000 %, fällig 01.09.2041	230	0,13	83 Government National Mortgage Association, Series 2010 H24, Class FA, 4,147 %, fällig 20.10.2060 *	83	0,05
457 Freddie Mac Pool 'SC0206', 2,000 %, fällig 01.11.2041	406	0,23	1 Government National Mortgage Association, Series 2010 H26, Class LF, 4,147 %, fällig 20.08.2058 *	1	–
71 Freddie Mac Pool 'SC0269', 2,000 %, fällig 01.01.2042	64	0,04	7 Government National Mortgage Association, Series 2011 H09, Class AF, 4,297 %, fällig 20.03.2061 *	7	–
39 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 01.07.2047	38	0,02	233 Government National Mortgage Association, Series 2013 107, Class AD, 2,776 %, fällig 16.11.2047 *	215	0,12
154 Freddie Mac Pool 'SD2138', 5,500 %, fällig 01.01.2053	158	0,09	3.715 Government National Mortgage Association, Series 2013 50, Class IO, 0,064 %, fällig 16.10.2048 *	7	–
614 Freddie Mac Pool 'SD2688', 5,500 %, fällig 01.04.2053	633	0,36	735 Government National Mortgage Association, Series 2014 169, Class IO, 0,585 %, fällig 16.10.2056 *	16	0,01
515 Freddie Mac Pool 'SD3642', 6,000 %, fällig 01.09.2053	540	0,31	33 Government National Mortgage Association, Series 2014 17, Class AM, 3,535 %, fällig 16.06.2048 *	32	0,02
156 Freddie Mac Pool 'SD5420', 6,000 %, fällig 01.05.2054	162	0,09	160 Government National Mortgage Association, Series 2014 176, Class IA, 4,000 %, fällig 20.11.2044	28	0,02
994 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	883	0,50	452 Government National Mortgage Association, Series 2014 H20, Class FA, 4,227 %, fällig 20.10.2064 *	452	0,26
156 Freddie Mac Pool 'SD8257', 4,500 %, fällig 01.10.2052	155	0,09	338 Government National Mortgage Association, Series 2015 167, Class OI, 4,000 %, fällig 16.04.2045	66	0,04
2.142 Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	500	0,28	628 Government National Mortgage Association, Series 2015 183, Class IO, 0,435 %, fällig 16.09.2057 *	14	0,01
905 Freddie Mac REMICS 5010, Class IK, 2,500 %, fällig 25.09.2050	137	0,08	562 Government National Mortgage Association, Series 2016 21, Class ST, 2,368 %, fällig 20.02.2046 *	71	0,04
1.557 Freddie Mac REMICS 5093, Class IY, 4,500 %, fällig 25.12.2050	338	0,19	266 Government National Mortgage Association, Series 2016 84, Class IG, 4,500 %, fällig 16.11.2045	51	0,03
1.174 Freddie Mac REMICS 5115, Class IO, 4,500 %, fällig 25.10.2049	252	0,14	853 Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,527 %, fällig 16.02.2059 *	25	0,01
604 Freddie Mac REMICS 5159, Class IP, 3,000 %, fällig 25.11.2051	87	0,05	923 Government National Mortgage Association, Series 2017 132, Class IA, 4,500 %, fällig 20.09.2047	166	0,09
482 Freddie Mac REMICS 5168, Class CI, 4,000 %, fällig 25.11.2051	94	0,05	753 Government National Mortgage Association, Series 2017 157, Class IO, 0,520 %, fällig 16.12.2059 *	24	0,01
1.200 Freddie Mac REMICS 5224, Class HL, 4,000 %, fällig 25.04.2052	1.151	0,65	567 Government National Mortgage Association, Series 2017 28, Class IO, 0,646 %, fällig 16.02.2057 *	20	0,01
81 Freddie Mac REMICS 5449, Class FQ, 5,167 %, fällig 25.09.2054 *	82	0,05	322 Government National Mortgage Association, Series 2017 41, Class IO, 0,494 %, fällig 16.07.2058 *	8	–
83 Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 4,967 %, fällig 25.12.2054 *	84	0,05	61 Government National Mortgage Association, Series 2017 H15, Class KI, 2,276 %, fällig 20.07.2067 *	3	–
950 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B1, 144A, 7,067 %, fällig 25.10.2041 *	965	0,55	2.077 Government National Mortgage Association, Series 2017 H18, Class BI, 1,515 %, fällig 20.09.2067 *	55	0,03
565 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M1B, 144A, 6,067 %, fällig 25.02.2042 *	572	0,32	25 Government National Mortgage Association, Series 2017 H20, Class IB, 2,210 %, fällig 20.10.2067 *	1	–
23 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	23	0,01	57 Government National Mortgage Association, Series 2018 H06, Class PF, 4,097 %, fällig 20.02.2068 *	57	0,03
35 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	37	0,02	577 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	107	0,06
37 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	35	0,02	222 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	42	0,02
296 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	285	0,16	1.732 Government National Mortgage Association, Series 2021 21, Class AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	1.343	0,76
55 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	51	0,03	871 Government National Mortgage Association, Series 2021 77, Class LC, 1,250 %, fällig 20.07.2050	702	0,40
132 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	124	0,07	1.500 Government National Mortgage Association, Series 2022 139, Class AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	1.406	0,80
275 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	258	0,15	1.660 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	74	0,04
180 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	169	0,10	1.966 Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	102	0,06
155 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	143	0,08			
10 Ginnie Mae II Pool '4961', 6,000 %, fällig 20.02.2041	11	0,01			
3 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20.07.2040	3	–			
42 Ginnie Mae II Pool '783368', 4,500 %, fällig 20.07.2041	42	0,02			
59 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	56	0,03			
471 Ginnie Mae II Pool '784894', 3,500 %, fällig 20.02.2048	448	0,25			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
890 Government National Mortgage Association, Series 2025 169, Class SA, 2,938 %, fällig 20.10.2055 *	98	0,06	Luxemburg – 0,10 % (28. Februar 2025: 0,20 %)		
793 Government National Mortgage Association, Series 2025 175, Class LS, 2,288 %, fällig 20.10.2055 *	80	0,05	260 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	180	0,10
592 Government National Mortgage Association, Series 2025 214, Class S, 2,938 %, fällig 20.12.2055 *	63	0,04	Macau – 0,47 % (28. Februar 2025: 0,67 %)		
11 HarborView Mortgage Loan Trust 2007-7, Series 2007 7, Class 2A1A, 5,788 %, fällig 25.10.2037 *	11	0,01	510 Sands China Ltd, 2,300 %, fällig 08.03.2027	501	0,28
578 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Series 2016 NINE, Class A, 144A, 2,854 %, fällig 06.09.2038 *	573	0,32	340 Sands China Ltd, 2,850 %, fällig 08.03.2029	326	0,19
233 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class A1B, 144A, 3,250 %, fällig 25.09.2056 *	225	0,13		827	0,47
346 PRPM 2024-NQM4 Trust, Series 2024 NQM4, Class A1, 144A, 5,674 %, fällig 26.12.2069	349	0,20	Mexiko – 0,19 % (28. Februar 2025: 0,25 %)		
490 STWD 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,116 %, fällig 19.11.2042 *	491	0,28	20 America Movil SAB de CV, 6,375 %, fällig 01.03.2035	23	0,01
690 UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C2, Series 2017 C2, Class A4, 3,487 %, fällig 15.08.2050	685	0,39	10 America Movil SAB de CV, 6,125 %, fällig 15.11.2037	11	0,01
402 UBS Commercial Mortgage Trust 2017-C7, Series 2017 C7, Class A3, 3,418 %, fällig 15.12.2050	398	0,23	250 Southern Copper Corp, 7,500 %, fällig 27.07.2035	298	0,17
71.014 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C9, Series 2018 C9, Class XA, 0,927 %, fällig 15.03.2051 *	1.083	0,61		332	0,19
466 Verus Securitization Trust 2025-R2, Series 2025 R2, Class A2, 144A, 5,238 %, fällig 25.07.2067	471	0,27	Marokko – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,08 %)		
104 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2007-OA2 Trust, Series 2007 OA2, Class 2A, 4,713 %, fällig 25.03.2047 *	99	0,06	270 OCP SA, 144A, 5,125 %, fällig 23.06.2051	226	0,13
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 75.258 \$)	74.455	42,13	Spanien – 0,24 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 38,18 % (28. Februar 2025: 33,05 %)			200 Banco Santander SA, 4,551 %, fällig 06.11.2030	202	0,12
Belgien – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,01 %)			210 CaixaBank SA, 144A, 4,885 %, fällig 03.07.2031 *	214	0,12
28 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	26	0,01		416	0,24
Brasilien – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,20 %)			Supranational – 0,48 % (28. Februar 2025: 0,66 %)		
510 Suzano Austria GmbH, Series DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	463	0,26	INR 76.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	850	0,48
Kanada – 0,32 % (28. Februar 2025: 0,29 %)			Schweiz – 1,02 % (28. Februar 2025: 0,93 %)		
20 Bank of Montreal, 3,803 %, fällig 15.12.2032 *	20	0,01	420 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	419	0,24
90 Bank of Nova Scotia/The, 4,588 %, fällig 04.05.2037 *	89	0,05	720 UBS Group AG, 144A, 3,091 %, fällig 14.05.2032 *	674	0,38
10 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	10	0,01	200 UBS Group AG, 144A, 2,746 %, fällig 11.02.2033 *	181	0,10
160 Barrick North America Finance LLC, 5,750 %, fällig 01.05.2043	166	0,09	250 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	293	0,17
200 Rogers Communications Inc, 5,300 %, fällig 15.02.2034	204	0,12	220 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	240	0,13
20 Teck Resources Ltd, 6,000 %, fällig 15.08.2040	21	0,01		1.807	1,02
50 Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	56	0,03	Vereinigte Arabische Emirate – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,14 %)		
	566	0,32	360 DP World Ltd. United Arab Emirates, 5,625 %, fällig 25.09.2048	353	0,20
China – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,13 %)			USA – 31,77 % (28. Februar 2025: 25,77 %)		
420 Prosus NV, 144A, 3,832 %, fällig 08.02.2051	287	0,16	110 Abbott Laboratories, 4,000 %, fällig 15.03.2031	110	0,06
Kolumbien – 0,27 % (28. Februar 2025: 0,22 %)			180 Abbott Laboratories, 4,300 %, fällig 15.03.2033	180	0,10
540 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	484	0,27	100 Abbott Laboratories, 4,650 %, fällig 15.03.2036	100	0,06
Frankreich – 1,00 % (28. Februar 2025: 0,79 %)			50 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 15.03.2038	50	0,03
360 BNP Paribas SA, 144A, 5,198 %, fällig 10.01.2030 *	370	0,21	90 Abbott Laboratories, 5,500 %, fällig 15.03.2056	90	0,05
590 BNP Paribas SA, 144A, 5,894 %, fällig 05.12.2034 *	633	0,36	1.150 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	1.124	0,64
710 BNP Paribas SA, 144A, 8,500 %, Ewige Anleihe *	760	0,43	60 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	62	0,04
	1.763	1,00	10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,01
Deutschland – 0,12 % (28. Februar 2025: 0,42 %)			80 Alphabet Inc, 3,700 %, fällig 15.02.2029	80	0,05
210 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	211	0,12	40 Alphabet Inc, 4,100 %, fällig 15.02.2031	40	0,02
Indien – 0,22 % (28. Februar 2025: 0,15 %)			20 Alphabet Inc, 4,400 %, fällig 15.02.2033	20	0,01
520 Reliance Industries Ltd, 144A, 3,625 %, fällig 12.01.2052	391	0,22	40 Alphabet Inc, 4,500 %, fällig 15.05.2035	40	0,02
Irland – 0,22 % (28. Februar 2025: 0,25 %)			110 Alphabet Inc, 4,700 %, fällig 15.11.2035	111	0,06
200 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	195	0,11	60 Alphabet Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	61	0,03
200 Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	199	0,11	40 Alphabet Inc, 5,350 %, fällig 15.11.2045	40	0,02
	394	0,22	110 Alphabet Inc, 5,500 %, fällig 15.02.2046	112	0,06
Israel – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,34 %)			60 Alphabet Inc, 5,250 %, fällig 15.05.2055	58	0,03
232 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	230	0,13	90 Alphabet Inc, 5,650 %, fällig 15.02.2056	92	0,05
240 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	276	0,16	70 Alphabet Inc, 5,300 %, fällig 15.05.2065	66	0,04
	506	0,29	290 Amazon.com Inc, 4,100 %, fällig 20.11.2030	292	0,17
Japan – 0,35 % (28. Februar 2025: 0,39 %)			70 Amazon.com Inc, 4,350 %, fällig 20.03.2033	71	0,04
300 Nissan Motor Co Ltd, 144A, 4,345 %, fällig 17.09.2027	298	0,17	90 Amazon.com Inc, 4,650 %, fällig 20.11.2035	91	0,05
310 NTT Finance Corp, 144A, 5,171 %, fällig 16.07.2032	321	0,18	570 Amazon.com Inc, 3,875 %, fällig 22.08.2037	528	0,30
	619	0,35	150 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	137	0,08
Kasachstan – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,12 %)			34 Amgen Inc, 4,663 %, fällig 15.06.2051	30	0,02
340 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	313	0,18	20 Amrize Finance US LLC, 4,950 %, fällig 07.04.2030	21	0,01
Kuwait – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,13 %)			60 Amrize Finance US LLC, 5,400 %, fällig 07.04.2035	63	0,04
320 EQUATE Petrochemical Co KSC, 144A, 4,250 %, fällig 03.11.2026	320	0,18	90 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	94	0,05
			240 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	236	0,13
			150 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	134	0,08
			60 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	52	0,03
			100 AT&T Inc, 5,375 %, fällig 15.08.2035	104	0,06
			50 AT&T Inc, 5,350 %, fällig 01.09.2040	50	0,03
			190 AT&T Inc, 5,550 %, fällig 15.08.2041	190	0,11
			161 AT&T Inc, 4,350 %, fällig 15.06.2045	136	0,08
			118 AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	99	0,06
			10 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 01.12.2057	7	–
			25 AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	17	0,01
			120 Bank of America Corp, 3,500 %, fällig 19.04.2026	120	0,07
			330 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	331	0,19
			130 Bank of America Corp, 4,376 %, fällig 27.04.2028 *	131	0,07
			470 Bank of America Corp, 3,419 %, fällig 20.12.2028 *	465	0,26
			750 Bank of America Corp, 3,970 %, fällig 05.03.2029 *	750	0,42
			1.090 Bank of America Corp, 2,572 %, fällig 20.10.2032 *	993	0,56
			560 Bank of America Corp, 2,972 %, fällig 04.02.2033 *	518	0,29
			270 Bank of America Corp, 4,330 %, fällig 15.03.2050 *	230	0,13
			250 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	203	0,11
			37 Becton Dickinson & Co, 4,685 %, fällig 15.12.2044	34	0,02
			1.570 Boston Properties LP, 3,400 %, fällig 21.06.2029	1.530	0,87
			130 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	129	0,07
			280 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	293	0,17
			50 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	52	0,03

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
180 Broadcom Inc, 4,600 %, fällig 15.01.2033	182	0,10	20 EQT Corp, 144A, 3,125 %, fällig 15.05.2026	20	0,01
490 Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	429	0,24	64 EQT Corp, 3,900 %, fällig 01.10.2027	64	0,04
80 Broadcom Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	80	0,05	200 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	204	0,12
150 Cameron LNG LLC, 144A, 3,302 %, fällig 15.01.2035	134	0,08	120 EQT Corp, 144A, 3,625 %, fällig 15.05.2031	115	0,06
210 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	192	0,11	40 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	40	0,02
100 Centene Corp, 4,250 %, fällig 15.12.2027	99	0,06	320 Exxon Mobil Corp, 4,114 %, fällig 01.03.2046	274	0,15
180 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	197	0,11	80 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,300 %, fällig 15.03.2029	80	0,05
690 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	690	0,39	70 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,650 %, fällig 15.03.2031	70	0,04
100 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	102	0,06	50 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 4,950 %, fällig 15.03.2033	50	0,03
440 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,550 %, fällig 01.06.2034	468	0,26	10 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2036	10	0,01
350 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	325	0,18	400 FirstEnergy Corp, Series B, 3,900 %, fällig 15.07.2027	402	0,23
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,484 %, fällig 23.10.2045	247	0,14	360 FirstEnergy Corp, Series C, 4,850 %, fällig 15.07.2047	322	0,18
10 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.05.2047	8	–	120 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	124	0,07
70 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	61	0,03	210 Ford Motor Credit Co LLC, 7,350 %, fällig 04.11.2027	219	0,12
280 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	261	0,15	470 Foundry JV Holdco LLC, 144A, 5,875 %, fällig 25.01.2034	491	0,28
140 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	142	0,08	80 Fox Corp, 6,500 %, fällig 13.10.2033	88	0,05
30 Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	29	0,02	240 Freeport-McMoRan Inc, 5,400 %, fällig 14.11.2034	251	0,14
300 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	302	0,17	110 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	109	0,06
700 Citigroup Inc, 3,520 %, fällig 27.10.2028 *	695	0,39	60 GE Vernova Inc, 4,250 %, fällig 04.02.2031	60	0,03
1.170 Citigroup Inc, 4,075 %, fällig 23.04.2029 *	1.172	0,66	60 GE Vernova Inc, 4,875 %, fällig 04.02.2036	61	0,03
1.270 Citigroup Inc, 4,412 %, fällig 31.03.2031 *	1.277	0,72	30 GE Vernova Inc, 5,500 %, fällig 04.02.2056	30	0,02
20 Citigroup Inc, 2,520 %, fällig 03.11.2032 *	18	0,01	120 General Motors Co, 5,600 %, fällig 15.10.2032	126	0,07
10 Citigroup Inc, 4,910 %, fällig 24.05.2033 *	10	0,01	100 GFL Environmental Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.08.2028	99	0,06
5 Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	5	–	10 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,615 %, fällig 15.03.2028 *	10	0,01
240 Citigroup Inc, 6,625 %, Everige Anleihe *	248	0,14	870 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,814 %, fällig 23.04.2029 *	865	0,49
20 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 01.06.2040	15	0,01	180 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	181	0,10
170 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	184	0,10	950 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,650 %, fällig 21.10.2032 *	865	0,49
280 Comcast Corp, 3,400 %, fällig 01.04.2030	274	0,15	100 Goldman Sachs Group Inc/The, 6,250 %, fällig 01.02.2041	109	0,06
250 Comcast Corp, 4,250 %, fällig 15.10.2030	252	0,14	360 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,750 %, fällig 21.10.2045	327	0,18
13 Comcast Corp, 6,500 %, fällig 15.11.2035	15	0,01	60 Halliburton Co, 4,850 %, fällig 15.11.2035	60	0,03
150 Comcast Corp, 3,900 %, fällig 01.03.2038	133	0,08	10 HCA Inc, 5,875 %, fällig 01.02.2029	10	0,01
250 Comcast Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2040	211	0,12	450 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	436	0,25
50 Comcast Corp, 5,350 %, fällig 15.05.2053	46	0,03	440 Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	420	0,24
20 CommonSpirit Health, 4,350 %, fällig 01.11.2042	18	0,01	360 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	299	0,17
20 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	20	0,01	20 Home Depot Inc/The, 3,350 %, fällig 15.04.2050	14	0,01
120 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20B, 3,950 %, fällig 01.04.2050	95	0,05	120 Howmet Aerospace Inc, 4,550 %, fällig 15.11.2032	122	0,07
960 Coterra Energy Inc, 3,900 %, fällig 15.05.2027	959	0,54	10 Humana Inc, 3,125 %, fällig 15.08.2029	10	0,01
300 CSC Holdings LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.12.2030	183	0,10	10 Humana Inc, 2,150 %, fällig 03.02.2032	9	–
200 CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	119	0,07	10 Humana Inc, 4,625 %, fällig 01.12.2042	9	–
200 CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	120	0,07	20 Humana Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2047	17	0,01
8 CVS Health Corp, 4,300 %, fällig 25.03.2028	8	–	50 ILCF E-Capital Trust II, 144A, 6,600 %, fällig 21.12.2065 *	44	0,02
530 CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	522	0,30	220 Intel Corp, 1,600 %, fällig 12.08.2028	208	0,12
100 CVS Health Corp, 2,125 %, fällig 15.09.2031	89	0,05	180 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	186	0,10
570 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	545	0,31	20 Intel Corp, 3,734 %, fällig 08.12.2047	15	0,01
34 CVS Health Corp, 4,125 %, fällig 01.04.2040	30	0,02	10 Intel Corp, 4,750 %, fällig 25.03.2050	8	–
10 CVS Health Corp, 5,125 %, fällig 20.07.2045	9	–	180 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.05.2033	185	0,10
8 CVS Pass-Through Trust, 6,036 %, fällig 10.12.2028	8	–	880 JPMorgan Chase & Co, 3,509 %, fällig 23.01.2029 *	873	0,49
40 Devon Energy Corp, 5,600 %, fällig 15.07.2041	40	0,02	340 JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	342	0,19
80 Devon Energy Corp, 4,750 %, fällig 15.05.2042	73	0,04	780 JPMorgan Chase & Co, 4,452 %, fällig 05.12.2029 *	788	0,45
10 Diamondback Energy Inc, 3,250 %, fällig 01.12.2026	10	0,01	290 JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	272	0,15
20 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	20	0,01	200 JPMorgan Chase & Co, 5,576 %, fällig 23.07.2036 *	208	0,12
42 Discovery Global Holdings Inc, 3,755 %, fällig 15.03.2027	42	0,02	10 JPMorgan Chase & Co, 4,950 %, fällig 01.06.2045	10	0,01
260 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026 †	257	0,15	20 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	21	0,01
230 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026 †	224	0,13	10 Kinder Morgan Inc, 5,550 %, fällig 01.06.2045	10	0,01
40 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028 †	39	0,02	10 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	9	0,01
10 Duke Energy Carolinas LLC, 5,300 %, fällig 15.02.2040	10	0,01	130 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	132	0,07
10 El Paso Natural Gas Co LLC, 8,375 %, fällig 15.06.2032	12	0,01	270 Las Vegas Sands Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2028	277	0,16
10 Elevance Health Inc, 4,100 %, fällig 15.05.2032	10	0,01	220 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	230	0,13
20 Elevance Health Inc, 4,550 %, fällig 15.05.2052	17	0,01	50 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 14.06.2030	53	0,03
710 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	727	0,41	160 Lehman Brothers Escrow, Series DMTN, Nullkupon, Everige Anleihe	–	–
300 Eli Lilly & Co, 4,600 %, fällig 14.08.2034	305	0,17	10 McDonald's Corp, 3,600 %, fällig 01.07.2030	10	0,01
80 Eli Lilly & Co, 5,000 %, fällig 09.02.2054	75	0,04	230 McDonald's Corp, 4,200 %, fällig 01.04.2050	190	0,11
120 Eli Lilly & Co, 5,100 %, fällig 09.02.2064	112	0,06	320 Meta Platforms Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	325	0,18
570 Enterprise Products Operating LLC, 4,850 %, fällig 31.01.2034	583	0,33	100 Meta Platforms Inc, 4,875 %, fällig 15.11.2035	101	0,06
220 Enterprise Products Operating LLC, 5,375 %, fällig 15.02.2078 *	222	0,13	120 Meta Platforms Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2045	119	0,07
10 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	10	0,01	100 Meta Platforms Inc, 5,625 %, fällig 15.11.2055	98	0,06
			210 Meta Platforms Inc, 5,750 %, fällig 15.11.2065	205	0,12
			100 MetLife Inc, 6,400 %, fällig 15.12.2036	105	0,06
			280 Micron Technology Inc, 5,300 %, fällig 15.01.2031	294	0,17
			10 Micron Technology Inc, 5,875 %, fällig 09.02.2033	11	0,01
			10 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	7	–
			200 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,370 %, fällig 15.04.2029	199	0,11
			200 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 7,422 %, fällig 15.01.2056 *	197	0,11
			400 Morgan Stanley, 3,772 %, fällig 24.01.2029 *	399	0,23
			830 Morgan Stanley, 2,699 %, fällig 22.01.2031 *	786	0,44
			350 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	342	0,19

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
120 Morgan Stanley, 4,493 %, fällig 16.01.2032 *	121	0,07	20 US Bancorp, Series mtn, 2,215 %, fällig 27.01.2028 *	20	0,01
40 Morgan Stanley, 2,511 %, fällig 20.10.2032 *	36	0,02	250 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	260	0,15
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	20	0,01	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	11	0,01
180 MPLX LP, 4,500 %, fällig 15.04.2038	167	0,09	410 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	365	0,21
170 NVIDIA Corp, 3,700 %, fällig 01.04.2060	128	0,07	150 Verizon Communications Inc, 3,150 %, fällig 22.03.2030	145	0,08
50 Occidental Petroleum Corp, 3,200 %, fällig 15.08.2026	50	0,03	174 Verizon Communications Inc, 2,550 %, fällig 21.03.2031	161	0,09
360 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	352	0,20	250 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	249	0,14
260 Occidental Petroleum Corp, 7,875 %, fällig 15.09.2031	302	0,17	247 Verizon Communications Inc, 4,780 %, fällig 15.02.2035	246	0,14
100 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	109	0,06	360 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	367	0,21
90 Occidental Petroleum Corp, 6,200 %, fällig 15.03.2040	94	0,05	400 Verizon Communications Inc, 2,650 %, fällig 20.11.2040	292	0,16
60 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 01.04.2035	63	0,04	180 Verizon Communications Inc, 3,400 %, fällig 22.03.2041	143	0,08
50 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,800 %, fällig 01.04.2055	51	0,03	80 Verizon Communications Inc, 3,850 %, fällig 01.11.2042	66	0,04
10 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	10	0,01	10 Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046	9	–
230 ONEOK Inc, 5,800 %, fällig 01.11.2030	244	0,14	50 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047	49	0,03
370 Oracle Corp, 4,650 %, fällig 06.05.2030	369	0,21	70 Verizon Communications Inc, 3,550 %, fällig 22.03.2051	51	0,03
10 Oracle Corp, 4,950 %, fällig 04.02.2031	10	0,01	10 Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 23.02.2054	10	0,01
160 Oracle Corp, 2,875 %, fällig 25.03.2031	146	0,08	10 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	9	–
20 Oracle Corp, 5,350 %, fällig 04.05.2033	20	0,01	160 Vistra Operations Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 31.01.2036	161	0,09
20 Oracle Corp, 5,200 %, fällig 26.09.2035	19	0,01	30 Walt Disney Co/The, 6,650 %, fällig 15.11.2037	35	0,02
60 Oracle Corp, 5,875 %, fällig 26.09.2045	54	0,03	120 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	124	0,07
270 Oracle Corp, 5,375 %, fällig 27.09.2054	219	0,12	260 Wells Fargo & Co, 3,350 %, fällig 02.03.2033 *	244	0,14
30 Oracle Corp, 5,950 %, fällig 26.09.2055	26	0,01	170 Wells Fargo & Co, 5,557 %, fällig 25.07.2034 *	179	0,10
50 Oracle Corp, 6,850 %, fällig 04.02.2066	48	0,03	910 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	833	0,47
310 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	302	0,17	590 Western Midstream Operating LP, 4,050 %, fällig 01.02.2030	583	0,33
80 Pacific Gas and Electric Co, 2,500 %, fällig 01.02.2031	73	0,04	170 Williams Cos Inc/The, Series A, 7,500 %, fällig 15.01.2031	194	0,11
130 Pacific Gas and Electric Co, 5,050 %, fällig am 15.10.2032	133	0,07	200 Williams Cos Inc/The, 7,750 %, fällig 15.06.2031	230	0,13
30 Pacific Gas and Electric Co, 3,500 %, fällig 01.08.2050	21	0,01	718 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	878	0,50
100 Pfizer Inc, 2,625 %, fällig 01.04.2030	95	0,05	10 Williams Cos Inc/The, 5,150 %, fällig 15.03.2034	10	0,01
30 Pioneer Natural Resources Co, 1,900 %, fällig 15.08.2030	28	0,02		56.153	31,77
20 Pioneer Natural Resources Co, 2,150 %, fällig 15.01.2031	18	0,01	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 70.101 \$)		
50 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	52	0,03		67.487	38,18
720 Prologis LP, 1,250 %, fällig 15.10.2030	637	0,36	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 8,38 % (28. Februar 2025: 9,87 %)		
110 QUALCOMM Inc, 5,000 %, fällig 20.05.2035	113	0,06	Argentinien – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,32 %)		
330 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	327	0,18	220 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 4,125 %, fällig 09.07.2035	166	0,10
300 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 30.09.2031	309	0,17	427 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 6,625 %, fällig 01.09.2037	340	0,19
80 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,750 %, fällig 15.05.2033	81	0,05		506	0,29
30 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 27.02.2038	30	0,02	Brasilien – 0,88 % (28. Februar 2025: 1,14 %)		
100 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	103	0,06	BRL 5.700 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2027	1.085	0,61
30 Shell Finance US Inc, 4,550 %, fällig 12.08.2043	28	0,02	BRL 1.599 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	268	0,15
60 Shell Finance US Inc, 4,000 %, fällig 10.05.2046	50	0,03	200 Brazilian Government International Bond, 6,125 %, fällig 15.03.2034	206	0,12
70 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	73	0,04		1.559	0,88
740 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	776	0,44	Chile – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
10 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	10	0,01	CLP 190.000 Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos, 144A, 6,000 %, fällig 01.04.2033	229	0,13
180 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	211	0,12	Tschechische Republik – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
285 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	348	0,20	CZK 5.530 Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 103, 2,000 %, fällig 13.10.2033	233	0,13
10 Synopsys Inc, 4,850 %, fällig 01.04.2030	10	0,01	Dominikanische Republik – 0,25 % (28. Februar 2025: 0,17 %)		
60 Synopsys Inc, 5,000 %, fällig 01.04.2032	62	0,03	420 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 6,600 %, fällig 01.06.2036	442	0,25
50 Synopsys Inc, 5,150 %, fällig 01.04.2035	51	0,03	Kenia – 0,27 % (28. Februar 2025: 0,23 %)		
100 Synopsys Inc, 5,700 %, fällig 01.04.2055	100	0,06	520 Republik Kenia, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,300 %, fällig 23.01.2034	469	0,27
30 Targa Resources Corp, 4,200 %, fällig 01.02.2033	29	0,02	Malaysia – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
20 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	20	0,01	MYR 860 Malaysia, Staatsanleihe, Serie 0415, 4,254 %, fällig 31.05.2035	233	0,13
200 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,000 %, fällig 15.01.2032	194	0,11	Nigeria – 0,17 % (28. Februar 2025: 0,12 %)		
280 Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038	303	0,17	300 Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,500 %, fällig 28.11.2027	305	0,17
20 Time Warner Cable LLC, 5,875 %, fällig 15.11.2040	19	0,01	Peru – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,09 %)		
660 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	655	0,37	PEN 360 Peru, Staatsanleihe, 5,400 %, fällig 12.08.2034	107	0,06
10 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	9	0,01	210 Peru, Internationale Staatsanleihe, 5,375 %, fällig 08.02.2035	217	0,12
380 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	357	0,20		324	0,18
90 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	87	0,05			
10 T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032	9	–			
10 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	10	0,01			
50 T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041	38	0,02			
10 T-Mobile USA Inc, 3,300 %, fällig 15.02.2051	7	–			
110 T-Mobile USA Inc, 5,875 %, fällig 15.11.2055	111	0,06			
10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	10	0,01			
500 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	430	0,24			
330 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	244	0,14			
630 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	630	0,36			
420 United Rentals North America Inc, 3,750 %, fällig 15.01.2032	397	0,22			
140 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	129	0,07			
110 UnitedHealth Group Inc, 2,300 %, fällig 15.05.2031	100	0,06			
400 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.05.2032	399	0,23			
160 UnitedHealth Group Inc, 4,250 %, fällig 15.06.2048	132	0,07			
310 UnitedHealth Group Inc, 4,450 %, fällig 15.12.2048	264	0,15			
10 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	8	–			
20 UnitedHealth Group Inc, 3,875 %, fällig 15.08.2059	15	0,01			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Südafrika – 0,14 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
ZAR 3.730	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2044, 8,750 %, fällig 31.01.2044	0,14			
USA – 5,75 % (28. Februar 2025: 7,08 %)					
1.440	Federal National Mortgage Association, 6,625 %, fällig 15.11.2030	0,92			
1.310	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034 β	0,79			
10	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.08.2026	0,01			
180	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 15.04.2028	0,10			
140	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2029	0,08			
10	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.11.2029	0,01			
30	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.05.2030	0,02			
40	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	0,02			
520	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.07.2030	0,30			
40	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.10.2032	0,02			
620	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.05.2035	0,36			
130	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2035	0,07			
90	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.11.2044	0,05			
250	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.02.2045	0,14			
30	United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 15.05.2045	0,02			
420	United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 15.08.2045	0,25			
1.260	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.02.2050	0,44			
2.970	United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	0,86			
300	United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	0,10			
370	United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	0,14			
1.030	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051 ≠	0,35			
620	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	0,35			
430	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.11.2054	0,24			
20	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2055	0,01			
180	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	0,10			
		10,168			5,75
Uruguay – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
UYU 3.930	Uruguay, Internationale Staatsanleihe, 8,250 %, fällig 21.05.2031	0,06			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 16.609 \$)					
		14.813			8,38
Schuldscheindarlehen – 1,32 % (28. Februar 2025: 1,68 %)					
109	AmVINS Group Inc, 5,672 %, fällig 30.01.2032 *	0,06			
217	Asurion LLC, 0,000 %, fällig 14.02.2033 *	0,12			
159	Belron Finance 2019 LLC, 5,660 %, fällig 16.10.2031 *	0,09			
220	Calpine Construction Finance Co LP, 5,422 %, fällig 31.07.2031 *	0,13			
142	Chart Industries Inc, 6,161 %, fällig 18.03.2030 *	0,08			
194	Citadel Securities LP, 5,672 %, fällig 24.10.2031 *	0,11			
218	Focus Financial Partners LLC, 6,172 %, fällig 15.09.2031 *	0,12			
108	GIP Pilot Acquisition Partners LP, 5,646 %, fällig am 04.10.2030 *	0,06			
159	Iron Mountain Inc, 5,672 %, fällig 31.01.2031 *	0,09			
218	Jane Street Group LLC, 5,822 %, fällig 15.12.2031 *	0,12			
109	Lightning Power LLC, 5,922 %, fällig 18.08.2031 *	0,06			
29	Medline Borrower LP, 5,422 %, fällig 23.10.2028 *	0,02			
255	PCI Gaming Authority, 5,672 %, fällig 06.06.2031 *	0,14			
109	Peer Holding III Bv, 6,172 %, fällig 01.07.2031 *	0,06			
109	Starwood Property Mortgage LLC, 5,422 %, fällig 18.11.2027 *	0,06			
		2.335			1,32
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 2.347 \$)					
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
2.840	Credit Suisse Group AG Escrow †∞	–			–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)					
		–			–
Optionsscheine – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
USA – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
	9 Spirit Aviation Holdings †∞	4			–
	1 Spirit Aviation Holdings †∞	–			–
	13 Spirit Aviation Holdings †∞	6			0,01
	1 Spirit Aviation Holdings †∞	1			–
		11			0,01
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 306 \$)					
		11			0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 183.284 \$)					
		176.545			99,89
Kontrakte (in Tsd.)					
Gekaufte Optionen: 0,01 % (28. Februar 2025: 0,22 %)					
	– U.S. 5 Year W1 März 2026 Call 109.75, fällig 06.03.2026 – Morgan Stanley	15			0,01
Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 9 \$)					
		15			0,01
Credit Default Swaps – 0,11 % (28. Februar 2025: 0,20 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	203			0,11
Zinsswaps – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	33			0,02
Swaptions – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	94			0,06
Devisenterminkontrakte – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,09 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	111			0,06
Futures – 0,15 % (28. Februar 2025: 0,50 %)					
	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	256			0,15
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					
		177.257			100,30
Kontrakte (in Tsd.)					
Verkaufte Optionen – 0,01 % (28. Februar 2025: -0,13 %)					
	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Call 97.50, fällig 11.12.2026 – Morgan Stanley	-6			-0,01
	– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Put 96.50, fällig 11.12.2026 – Morgan Stanley	-6			–
	– CME 3 Month SOFR Futures September 2026 Call 97.50, fällig 11.09.2026 – Morgan Stanley	-5			–
Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -35 \$)					
		-17			-0,01
Index-Swaps – 0,03 % (28. Februar 2025: -0,20 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-46			-0,03
Inflationsswaps – -0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-42			-0,02
Swaptions – -0,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-85			-0,05
Devisenterminkontrakte – -0,17 % (28. Februar 2025: -0,12 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-312			-0,17
Futures – -0,12 % (28. Februar 2025: -0,25 %)					
	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-208			-0,12
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten					
		-710			-0,40
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten					
		176.547			99,90
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte					
		197			0,10
Gesamtnettovermögen					
		176.744 \$			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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 41.699.000 \$ und machten 23,59 % des Nettovermögens aus.				
*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.				
†	Nicht liquide.				
∞	Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.				
ε	Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).				
≠	Das Wertpapier (in seiner Gesamtheit oder in Teilen) ist zum 28. Februar 2026 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 2026.				

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

Ewige Anleihe	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit.
TBA	– To be announced.
BRL	– Brasilianischer Real
CLP	– Chilenischer Peso
CZK	– Tschechische Krone
INR	– Indische Rupie
MYR	– Malaysischer Ringgit
PEN	– Peruanischer Nuevo Sol
UYU	– Uruguayischer Peso
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	90,34
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	1,21
Finanzderivate	0,37
Sonstige Vermögenswerte	8,08
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	10.373	\$ 203
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 504 \$)				\$ 203
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -201 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 303 \$)				\$ 203

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,250 %	02. Jan. 2031	7.606	\$ 12
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,300 %	02. Jan. 2031	11.700	\$ 21
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 33
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 33

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,420 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR OIS Compound	31. Aug. 2032	7.824	\$ -46
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 128 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -505 \$)				-46
Nettowertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -377 \$)				\$ -46

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	21. Nov. 2030	8.320	\$ -42
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-42
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ -42

Aufstellung von Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	26. Sep. 2026	1.330	\$ 5
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	5.870	-85
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	25.170	89
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 94
Nicht realisierte Wertminderung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-85
Nettowertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 9

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 3.303	Verkauf BRL 18.139	\$ -235
03. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf BRL 5.300	Verkauf USD 1.017	17
03. März 2026	JP Morgan	Kauf BRL 12.839	Verkauf USD 2.481	23
13. März 2026	BNY	Kauf USD –	Verkauf AUD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf AUD –	Verkauf USD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 2	Verkauf USD 3	–
13. März 2026	BNY	Kauf EUR –	Verkauf USD –	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	299	Verkauf	USD	356	\$ -3
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	192	Verkauf	USD	137	–
16. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	EUR	848	Verkauf	USD	1.005	-1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	424	Verkauf	EUR	360	-2
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	302	Verkauf	EUR	255	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	232	Verkauf	GBP	172	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	446	Verkauf	JPY	69.148	1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	AUD	700	Verkauf	USD	497	2
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	110	Verkauf	USD	131	-1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	160	Verkauf	USD	189	–
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	117	Verkauf	AUD	170	-4
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	129	Verkauf	CAD	178	-2
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	608	Verkauf	EUR	516	-3
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	879	Verkauf	INR	79.640	7
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	EUR	194	Verkauf	USD	227	3
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	CNH	1.646	Verkauf	USD	238	3
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	865	Verkauf	AUD	1.267	-36
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	476	Verkauf	CNH	3.296	-6
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	AUD	1.375	Verkauf	USD	926	52
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	CNH	1.650	Verkauf	USD	238	3
02. Jun. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	2.430	Verkauf	BRL	12.839	-19
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 232 \$)								\$ 111
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -296 \$)								-312
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -64 \$)								\$ -201

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	84	\$ 20.226	\$ -65
3 Month SOFR Index März 2026	Morgan Stanley	81	19.513	-31
Australia 10 Year Bond März 2026	Morgan Stanley	17	1.337	11
Long Gilt Juni 2026	Morgan Stanley	8	1.010	11
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	-76	-8.650	-83
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Morgan Stanley	-24	-2.802	-28
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	-4	-837	-1
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	269	29.628	120
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	83	9.833	97
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	10	1.216	17
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.256 \$)				\$ 256
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -634 \$)				-208
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 622 \$)				\$ 48

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 5,79 % (28. Februar 2025: 5,96 %)					
650 AGL CLO 22 Ltd, Series 2022 22A, Class D1R, 144A, 6,368 %, fällig 20.01.2037 *	642	0,34	1.100 B3 SA - Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	1.041	0,56
680 AGL CLO 35 Ltd, Series 2024 35A, Class D1, 144A, 6,520 %, fällig 21.01.2038 *	684	0,37	630 Suzano Austria GmbH, 5,000 %, fällig 15.01.2030	636	0,34
620 Apidos CLO L, Series 2024 50A, Class D1, 144A, 6,468 %, fällig 20.01.2038 *	623	0,33		1.677	0,90
765 Arbys Funding LLC, Series 2020 1A, Class A2, 144A, 3,237 %, fällig 30.07.2050	750	0,40	Chile – 0,55 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
430 CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.10.2037 *	432	0,23	1.000 Corp Nacional del Cobre de Chile, 144A, 5,529 %, fällig 30.01.2037	1.025	0,55
300 CBAM 2017-3 Ltd, Series 2017 3A, Class DR, 144A, 7,429 %, fällig 17.07.2034 *	302	0,16	China – 0,50 % (28. Februar 2025: 0,46 %)		
400 Hartwick Park CLO Ltd, Series 2023 1A, Class DR, 144A, 6,368 %, fällig 20.01.2037 *	394	0,21	1.380 Prosus NV, 3,832 %, fällig 08.02.2051	944	0,50
590 Home Equity Asset Trust 2005-6, Series 2005 6, Class M5, 4,733 %, fällig 25.12.2035 *	582	0,31	Kolumbien – 0,31 % (28. Februar 2025: 0,24 %)		
600 HPS Loan Management 2024-22 Ltd, Series 2024 22A, Class D1, 144A, 6,568 %, fällig 20.10.2037 *	605	0,32	550 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	584	0,31
102 Jack in the Box Funding LLC, Series 2019 1A, Class A2II, 144A, 4,476 %, fällig 25.08.2049	101	0,06	Dänemark – 0,46 % (28. Februar 2025: 0,34 %)		
276 Jack in the Box Funding LLC, Series 2022 1A, Class A2I, 144A, 3,445 %, fällig 26.02.2052	269	0,14	820 Danske Bank A/S, 7,000 %, Ewige Anleihe *	863	0,46
550 LCM 40 Ltd 40A, Class D1R, 144A, 7,422 %, fällig 15.01.2038 *	531	0,29	Dominikanische Republik – 0,24 % (28. Februar 2025: 0,18 %)		
830 Obra CLO 1 Ltd, Series 2024 1A, Class D1, 144A, 7,068 %, fällig 20.01.2038 *	839	0,45	430 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 7,000 %, fällig 30.06.2034	455	0,24
650 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class D1R, 144A, 6,768 %, fällig 20.01.2038 *	652	0,35	Finnland – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,28 %)		
770 Ocean Trails Clo XVI Ltd, Series 2024 16A, Class D1, 144A, 6,968 %, fällig 20.01.2038 *	774	0,41	EUR 800 Finnair Oyj, 4,250 %, fällig 27.11.2030	961	0,51
1.022 ServiceMaster Funding LLC, Series 2021 1, Class A2II, 144A, 3,113 %, fällig 30.07.2051	901	0,48	Frankreich – 3,36 % (28. Februar 2025: 2,75 %)		
840 Symphony CLO 40 Ltd, Series 2023 40A, Class D1R, 144A, 6,317 %, fällig 05.01.2038 *	844	0,45	404 Altice France SA, 144A, 9,500 %, fällig 01.11.2029	411	0,22
510 Trinitas CLO XIX Ltd, Series 2022 19A, Class D1R, 144A, 6,618 %, fällig 20.10.2033 *	512	0,27	500 Betlic Everest Group SAS, 5,125 %, fällig 10.12.2031	602	0,32
410 Valley Stream Park CLO Ltd, Series 2022 1A, Class DRR, 144A, 6,368 %, fällig 20.01.2037 *	411	0,22	EUR 1.000 BNP Paribas SA, 2,500 %, fällig 31.03.2032 *	1.176	0,63
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 10.703 \$)			350 BNP Paribas SA, 144A, 6,875 %, Ewige Anleihe *	352	0,19
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 3,44 % (28. Februar 2025: 3,79 %)			330 Credit Agricole SA, 5,862 %, fällig 09.01.2036 *	351	0,19
650 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class D, 144A, 5,505 %, fällig 15.09.2034 *	644	0,34	800 Credit Agricole SA, 5,875 %, Ewige Anleihe *	986	0,52
580 BANK 2018-BNK15, Series 2018 BN15, Class B, 4,654 %, fällig 15.11.2061 *	551	0,29	400 Engie SA, 3,875 %, fällig 06.03.2036	484	0,26
206 BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A3, 144A, 6,158 %, fällig 25.06.2064	208	0,11	EUR 500 Engie SA, 3,875 %, fällig 11.09.2037	594	0,32
167 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 7,882 %, fällig 25.07.2039 *	169	0,09	EUR 180 IPD 3 BV, 5,475 %, fällig 15.06.2031 *	204	0,11
260 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,032 %, fällig 25.01.2040 *	265	0,14	EUR 160 IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 15.06.2031	180	0,09
450 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 6,767 %, fällig 25.10.2041 *	456	0,24	EUR 370 Kapla Holding SAS, 5,000 %, fällig 30.04.2031	448	0,24
390 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 6,767 %, fällig 25.06.2043 *	405	0,22	EUR 420 Rexel SA, 5,250 %, fällig 15.09.2030	516	0,27
290 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R08, Series 2023 R08, Class 1M2, 144A, 6,167 %, fällig 25.10.2043 *	296	0,16		6.304	3,36
410 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R02, Series 2024 R02, Class 1M2, 144A, 5,467 %, fällig 25.02.2044 *	413	0,22	Deutschland – 2,50 % (28. Februar 2025: 1,86 %)		
710 CSAIL 2016-C7 Commercial Mortgage Trust, Series 2016 C7, Class C, 4,284 %, fällig 15.11.2049 *	678	0,36	1.400 Allianz SE, 3,200 %, Ewige Anleihe *	1.342	0,72
335 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	315	0,17	EUR 600 CT Investment GmbH, 6,375 %, fällig 15.04.2030	732	0,39
220 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 9,417 %, fällig 25.09.2042 *	235	0,13	EUR 390 E.ON SE, 3,500 %, fällig 16.04.2033	470	0,25
602 JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust 2015-C30, Series 2015 C30, Class A5, 4,226 %, fällig 15.07.2048 *	592	0,32	EUR 150 E.ON SE, 4,000 %, fällig 16.01.2040	179	0,09
786 Neighborly Issuer 2023-1, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,308 %, fällig 30.01.2053	796	0,43	EUR 70 EnBW International Finance BV, 4,000 %, fällig 24.01.2035	86	0,05
414 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	418	0,22	EUR 240 Nidda Healthcare Holding GmbH, 5,375 %, fällig 23.10.2030	294	0,16
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 6.309 \$)			EUR 500 ZF Europe Finance BV, 7,000 %, fällig 12.06.2030	637	0,34
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 53,19 % (28. Februar 2025: 40,94 %)			EUR 800 ZF Europe Finance BV, 5,500 %, fällig 17.02.2032	947	0,50
Australien – 0,23 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				4.687	2,50
EUR 370 Network Finance Co Pty Ltd, 3,500 %, fällig 05.09.2033	438	0,23	Guatemala – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,50 %)		
Belgien – 0,14 % (28. Februar 2025: 0,10 %)			963 Millicom International Cellular SA, 5,125 %, fällig 15.01.2028	961	0,51
EUR 220 Azelis Finance NV, 4,750 %, fällig 25.09.2029	269	0,14	Indonesien – 0,23 % (28. Februar 2025: 0,17 %)		
			460 Pertamina Persero PT, 3,100 %, fällig 27.08.2030	433	0,23
			Irland – 1,10 % (28. Februar 2025: 0,48 %)		
			440 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	411	0,22
			610 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6,950 %, fällig 10.03.2055 *	645	0,34
			EUR 860 Flutter Treasury DAC, 4,000 %, fällig 04.06.2031	1.010	0,54
				2.066	1,10
			Israel – 0,60 % (28. Februar 2025: 0,79 %)		
			EUR 300 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 7,375 %, fällig 15.09.2029	400	0,21
			373 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	371	0,20
			310 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	356	0,19
				1.127	0,60
			Italien – 1,80 % (28. Februar 2025: 1,06 %)		
			EUR 1.010 Fibercop SpA, 2,375 %, fällig 12.10.2027	1.189	0,63
			GBP 770 Intesa Sanpaolo SpA, 6,500 %, fällig 14.03.2029 *	1.082	0,58
			EUR 510 TeamSystem SpA, 5,516 %, fällig 31.07.2031 *	571	0,31
			EUR 440 Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 30.09.2030	527	0,28
				3.369	1,80
			Japan – 0,28 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			500 NIT Finance Corp, 144A, 5,171 %, fällig 16.07.2032	517	0,28
			Kasachstan – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,42 %)		
			460 KazMunayGas National Co JSC, 5,375 %, fällig 24.04.2030	474	0,25
			660 KazMunayGas National Co JSC, 144A, 3,500 %, fällig 14.04.2033	608	0,33
				1.082	0,58

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)							
Luxemburg – 1,28 % (28. Februar 2025: 0,32 %)							
EUR	390 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 3,500 %, fällig 29.01.2031	463	0,25	GBP	170 NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	238	0,13
EUR	180 Currenra Group Holdings Sarl, 5,500 %, fällig 15.05.2030	219	0,12	GBP	450 NIE Finance Plc, 5,875 %, fällig 03.09.2041	618	0,33
EUR	120 Essendi SA, 6,375 %, fällig 15.10.2029	149	0,08	GBP	730 Pinewood Finco Plc, 6,000 %, fällig 27.03.2030	995	0,53
EUR	130 Essendi SA, 5,375 %, fällig 15.05.2030	160	0,08	GBP	400 Pinnacle Bidco Plc, 10,000 %, fällig 11.10.2028	568	0,30
EUR	1.190 P3 Group Sarl, 3,375 %, fällig 22.03.2031	1.410	0,75	GBP	550 Premier Foods Finance Plc, 3,500 %, fällig 15.10.2026	738	0,39
		2.401	1,28	EUR	430 RAY Financing LLC, 6,500 %, fällig 15.07.2031	524	0,28
Mexiko – 1,14 % (28. Februar 2025: 0,93 %)				EUR	800 Sage Group Plc/The, 3,821 %, fällig 25.02.2033	945	0,50
	950 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 7,500 %, Ewige Anleihe *	982	0,52	GBP	429 Tesco Property Finance 5 Plc, 5,661 %, fällig 13.10.2041	591	0,31
	760 BBVA Mexico SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero BBVA Mexico/TX, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	757	0,40	GBP	540 Tesco Property Finance 6 Plc, 5,411 %, fällig 13.07.2044	727	0,39
	400 Comision Federal de Electricidad, 144A, 6,045 %, fällig 28.01.2034	405	0,22	GBP	810 Vmed O2 UK Financing I Plc, 4,500 %, fällig 15.07.2031	973	0,52
		2.144	1,14	GBP	1.000 Whitbread Group Plc, 2,375 %, fällig 31.05.2027	1.313	0,70
Niederlande – 2,41 % (28. Februar 2025: 2,09 %)				GBP	500 Whitbread Group Plc, 5,500 %, fällig 31.05.2032	686	0,37
EUR	420 Boels Topholding BV, 5,750 %, fällig 15.05.2030	513	0,27			19.515	10,41
EUR	200 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	242	0,13	USA – 16,49 % (28. Februar 2025: 14,29 %)			
EUR	1.190 CTP NV, 3,625 %, fällig 10.03.2031	1.427	0,76	GBP	930 1261229 BC Ltd, 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2032	963	0,51
EUR	770 Lineage Europe Finco BV, 4,125 %, fällig 26.11.2031	916	0,49		550 Alphabet Inc, 4,625 %, fällig 13.11.2032	748	0,40
EUR	560 Magnum Icc Finance BV, 3,750 %, fällig 26.11.2034	665	0,36		470 Amazon.com Inc, 4,350 %, fällig 20.03.2033	474	0,25
EUR	550 VZ Secured Financing BV, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2032	490	0,26		360 Amazon.com Inc, 4,650 %, fällig 20.11.2035	362	0,19
EUR	220 VZ Secured Financing BV, 5,250 %, fällig 15.01.2033	255	0,14		300 Amazon.com Inc, 5,450 %, fällig 20.11.2055	296	0,16
		4.508	2,41		600 American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	612	0,33
Peru – 0,21 % (28. Februar 2025: 0,17 %)					18 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 20.04.2026	18	0,01
	610 Petroleos del Peru SA, 5,625 %, fällig 19.06.2047	389	0,21		1.320 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	1.336	0,71
Polen – 0,38 % (28. Februar 2025: 0,26 %)					660 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	645	0,34
EUR	600 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA, 3,375 %, fällig 16.06.2028 *	716	0,38	EUR	550 AT&T Inc, 3,600 %, fällig am 01.06.2033	658	0,35
Südafrika – 0,46 % (28. Februar 2025: 0,08 %)					470 Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	484	0,26
	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 4,750 %, fällig 10.04.2027	202	0,11		280 Bank of America Corp, 5,288 %, fällig 25.04.2034 *	291	0,16
EUR	540 Anglo American Capital Plc, 4,125 %, fällig 15.03.2032	665	0,35		710 Bank of America Corp, 3,311 %, fällig 22.04.2042 *	567	0,30
		867	0,46		140 Bank of America Corp, 4,083 %, fällig 20.03.2051 *	114	0,06
Spanien – 3,11 % (28. Februar 2025: 1,69 %)				EUR	390 Carnival Plc, 4,125 %, fällig 15.07.2031	475	0,25
EUR	700 Aena SME SA, 3,500 %, fällig 22.01.2036	831	0,44		320 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	286	0,15
EUR	1.000 Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	1.249	0,67		400 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	378	0,20
EUR	800 Banco Santander SA, 6,000 %, Ewige Anleihe *	986	0,53		1.150 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	829	0,44
	260 CaixaBank SA, 144A, 6,037 %, fällig 15.06.2035 *	279	0,15		30 Cigna Group/The, 4,800 %, fällig 15.08.2038	29	0,02
EUR	500 CaixaBank SA, 3,875 %, fällig 20.01.2037 *	598	0,32	EUR	200 Citigroup Inc, 4,296 %, fällig 23.07.2036 *	240	0,13
EUR	300 CaixaBank SA, 4,000 %, fällig 05.03.2037 *	360	0,19		610 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	784	0,42
EUR	300 El Corte Ingles SA, 3,500 %, fällig 24.07.2033	354	0,19		510 Citigroup Inc, 6,625 %, Ewige Anleihe *	528	0,28
EUR	900 Iberdrola Finanzas SA, 3,750 %, Ewige Anleihe *	1.059	0,56		1.278 Continental Resources Inc/OK, 4,900 %, fällig 01.06.2044	1.054	0,56
EUR	89 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	106	0,06		750 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	475	0,25
		5.822	3,11		570 DCP Midstream Operating LP, 144A, 6,450 %, fällig 03.11.2036	623	0,33
Supranational – 1,08 % (28. Februar 2025: 0,86 %)					410 Devon Energy Corp, 5,200 %, fällig 15.09.2034	421	0,23
INR	90.200 European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig 26.10.2027	986	0,53		1.000 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026 †	989	0,53
INR	93.900 International Bank for Reconstruction & Development, 6,750 %, fällig 13.07.2029	1.029	0,55		220 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028 †	214	0,11
		2.015	1,08		590 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	589	0,32
Schweden – 0,49 % (28. Februar 2025: 0,33 %)					390 Ford Motor Credit Co LLC, 3,815 %, fällig 02.11.2027	387	0,21
EUR	750 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	907	0,49		455 Ford Motor Credit Co LLC, 2,900 %, fällig 10.02.2029	433	0,23
Schweiz – 0,93 % (28. Februar 2025: 0,59 %)					950 Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	940	0,50
EUR	250 UBS Group AG, 0,625 %, fällig 18.01.2033	246	0,13		235 Goldman Sachs Capital II, 4,696 %, Ewige Anleihe *	193	0,10
	1.000 UBS Group AG, 144A, 6,625 %, Ewige Anleihe *	1.002	0,54		590 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,625 %, fällig 29.10.2029 *	782	0,42
	480 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	492	0,26		1.380 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,387 %, fällig 02.02.2041 *	1.370	0,73
		1.740	0,93		400 Gulfstream Natural Gas System LLC, 144A, 5,600 %, fällig 23.07.2035	417	0,22
Vereinigtes Königreich – 10,41 % (28. Februar 2025: 8,07 %)				EUR	430 Iron Mountain Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2034	505	0,27
GBP	530 B&M European Value Retail plc, 4,000 %, fällig 15.11.2028	696	0,37		330 JPMorgan Chase & Co, 3,328 %, fällig 22.04.2052 *	236	0,13
GBP	180 B&M European Value Retail plc, 8,125 %, fällig 15.11.2030	255	0,14		260 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	264	0,14
EUR	800 Barclays Plc, 6,125 %, Ewige Anleihe *	950	0,51		100 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 14.06.2030	105	0,06
GBP	160 Boots Group Finco LP, 7,375 %, fällig 31.08.2032	225	0,12		770 Meta Platforms Inc, 4,875 %, fällig 15.11.2035	778	0,42
GBP	680 Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030	931	0,50		770 Meta Platforms Inc, 5,625 %, fällig 15.11.2055	754	0,40
GBP	1.299 Greene King Finance Plc, Series B2, 5,981 %, fällig 15.03.2036 *	1.614	0,86		760 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	743	0,40
	400 HSBC Holdings Plc, 4,762 %, fällig 29.03.2033 *	401	0,21		570 Occidental Petroleum Corp, 3,500 %, fällig 15.08.2029	558	0,30
EUR	330 INEOS Quattro Finance 2 Plc, 6,750 %, fällig 15.04.2030	329	0,18		1.040 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	1.030	0,55
GBP	740 Lloyds Banking Group Plc, 8,500 %, Ewige Anleihe *	1.058	0,56		270 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	282	0,15
GBP	260 Marks & Spencer Plc, 5,125 %, fällig 18.08.2032	356	0,19		110 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,750 %, fällig 15.05.2033	111	0,06
GBP	1.275 Marston's Issuer Plc, Series B1, 6,413 %, fällig 16.07.2035 *	1.628	0,87		170 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,375 %, fällig 15.01.2036	174	0,09
GBP	770 Nationwide Building Society, 7,875 %, Ewige Anleihe *	1.105	0,59		110 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 27.02.2038	110	0,06
GBP	740 NatWest Group Plc, 7,625 %, Ewige Anleihe *	1.051	0,56	EUR	140 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2033	164	0,09
					205 Southern Natural Gas Co LLC, 8,000 %, fällig 01.03.2032	240	0,13
					530 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 5,500 %, fällig 01.03.2030	540	0,29
					370 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	367	0,20
					900 T-Mobile USA Inc, 5,125 %, fällig 15.05.2032	935	0,50
					260 United Airlines Holdings Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2031	265	0,14
					650 United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031	627	0,33
				GBP	510 Wells Fargo & Co, 3,473 %, fällig 26.04.2028 *	681	0,36

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

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

REMIC	– Real Estate Mortgage Investment Conduit
BRL	– Brasilianischer Real
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
INR	– Indische Rupie
JPY	– Japanischer Yen
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	91,98
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	0,61
Finanzderivate	0,22
Sonstige Vermögenswerte	7,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf		20. Dez. 2030	5.050	\$ -601
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-601
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ -601

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2026	Citi	Kauf USD 1.978	Verkauf INR 179.305	\$ 9
12. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 1.894	Verkauf BRL 10.242	-98
12. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 3.173	Verkauf TWD 99.169	-7
12. März 2026	Morgan Stanley	Kauf TWD 51.591	Verkauf USD 1.628	26
13. März 2026	BNY	Kauf USD 2	Verkauf AUD 2	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 19	Verkauf EUR 16	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1	Verkauf EUR 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD –	Verkauf SGD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 4	Verkauf SGD 4	–
13. März 2026	BNY	Kauf SGD –	Verkauf USD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf AUD 396	Verkauf USD 281	1
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 464	Verkauf USD 636	-9
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 4.615	Verkauf USD 5.506	-49
13. März 2026	BNY	Kauf SGD 800	Verkauf USD 634	-1
13. März 2026	BNY	Kauf ZAR 336.046	Verkauf USD 21.107	-24
13. März 2026	BNY	Kauf CHF 54.777	Verkauf USD 71.719	-366
13. März 2026	BNY	Kauf ZAR 2.641	Verkauf USD 164	–
13. März 2026	BNY	Kauf EUR –	Verkauf USD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf PLN 8.653	Verkauf USD 2.450	-28
13. März 2026	BNY	Kauf USD 44	Verkauf ZAR 703	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 2.160	Verkauf ZAR 34.672	-15
12. Mai. 2026	Citi	Kauf USD 36.648	Verkauf EUR 30.958	-62
12. Mai. 2026	Citi	Kauf USD 377	Verkauf GBP 277	5
12. Mai. 2026	Citi	Kauf EUR 4.326	Verkauf GBP 3.763	57
12. Mai. 2026	HSBC	Kauf USD 2.519	Verkauf CNH 17.373	-25
12. Mai. 2026	Morgan Stanley	Kauf AUD 2.160	Verkauf USD 1.502	34
12. Mai. 2026	UBS	Kauf GBP 1.375	Verkauf EUR 1.574	-12
12. Mai. 2026	UBS	Kauf USD 18.056	Verkauf GBP 13.207	255
12. Mai. 2026	UBS	Kauf USD 587	Verkauf JPY 89.358	11
12. Mai. 2026	UBS	Kauf USD 4.598	Verkauf MXN 80.034	-19
12. Mai. 2026	UBS	Kauf JPY 603.852	Verkauf USD 3.906	-14
12. Mai. 2026	UBS	Kauf USD 3.616	Verkauf ZAR 58.193	-19
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 613 \$)				\$ 398
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.070 \$)				-748
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -457 \$)				\$ -350

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-52	\$ -7.217	\$ -48
Euro-Bund März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-48	-7.386	-105
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-1	-134	-2
Long Gilt Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-8	-1.010	-14
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-43	-5.020	-51
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	22	4.604	7
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	8	881	4
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	2	237	2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 62 \$)				\$ 13
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -532 \$)				-220
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -470 \$)				\$ -207

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 3,92 % (28. Februar 2025: 5,16 %)			Italien – 0,25 % (28. Februar 2025: 1,26 %)		
500 522 Funding CLO 2018-3A Ltd, Series 2018 3A, Class DR, 144A, 7,029 %, fällig 20.10.2031 *	502	0,63	200 Fibercomp SpA, 144A, 6,000 %, fällig 30.09.2034	196	0,25
250 AB BSL CLO 2 Ltd, Series 2021 2A, Class D, 144A, 7,284 %, fällig 15.04.2034 *	250	0,31	Luxemburg – 0,61 % (28. Februar 2025: 0,55 %)		
150 Abry Liquid Credit CLO 2025-2 Ltd, Series 2025 2A, Class D, 144A, 6,835 %, fällig 15.01.2039 *	152	0,19	200 Altice Financing SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2028	141	0,18
100 AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 6,568 %, fällig 17.07.2037 *	101	0,13	300 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	208	0,26
230 Bain Capital Credit CLO 2020-3 Ltd, Series 2020 3A, Class DRR, 144A, 6,771 %, fällig 23.10.2034 *	225	0,28	142 Altice France Lux 3 / Altice Holdings 1, 144A, 10,000 %, fällig 15.01.2033	134	0,17
250 Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,068 %, fällig 20.07.2037 *	253	0,32		483	0,61
300 GoldenTree Loan Management US CLO 16 Ltd, Series 2022 16A, Class DRR, 144A, 6,068 %, fällig 20.01.2038 *	298	0,38	Spanien – 0,61 % (28. Februar 2025: 0,53 %)		
150 Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 6,868 %, fällig 25.07.2037 *	151	0,19	400 Banco Santander SA, 9,625 %, Ewige Anleihe *	482	0,61
150 Katayma CLO II Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	151	0,19	Schweiz – 0,85 % (28. Februar 2025: 1,45 %)		
200 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class DR2, 144A, 7,422 %, fällig 15.10.2034 *	197	0,25	230 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	251	0,31
150 Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class ER, 144A, 11,168 %, fällig 20.07.2035 *	147	0,18	60 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.06.2028	62	0,08
130 OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D1, 144A, 6,568 %, fällig 20.07.2037 *	131	0,16	390 VistaJet Malta Finance Plc / Vista Management Holding Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2030	363	0,46
220 PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.04.2038 *	221	0,28		676	0,85
170 RR 18 Ltd, Series 2021 18A, Class DR, 144A, 8,572 %, fällig 15.07.2040 *	164	0,20	Vereinigtes Königreich – 3,58 % (28. Februar 2025: 2,75 %)		
180 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,071 %, fällig 23.07.2037 *	181	0,23	90 Brightstar Lottery Plc / Brightstar Global Solutions Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2033	90	0,11
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 3.105 \$)	3.124	3,92	210 Connect Finco SARM / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	223	0,28
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,53 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			530 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,750 %, fällig 15.01.2032	491	0,61
320 GS Mortgage Securities Trust 2014-GC24, Series 2014 GC24, Class B, 4,498 %, fällig 10.09.2047 *	311	0,39	800 HSBC Holdings Plc, 4,600 %, Ewige Anleihe *	763	0,96
117 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,137 %, fällig 15.05.2048 *	113	0,14	740 Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	804	1,01
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 421 \$)	424	0,53	510 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2033	484	0,61
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 88,03 % (28. Februar 2025: 88,49 %)				2.855	3,58
Kanada – 3,66 % (28. Februar 2025: 2,66 %)			USA – 70,76 % (28. Februar 2025: 69,11 %)		
250 Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig 27.01.2084 *	268	0,34	370 1261229 BC Ltd, 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2032	383	0,48
1.070 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	846	1,06	90 AAR Escrow Issuer LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2029	93	0,12
300 Bombardier Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.11.2030	322	0,40	80 Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig am 01.07.2032	79	0,10
240 Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	256	0,32	170 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2030	174	0,22
90 Bombardier Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.06.2032	95	0,12	180 Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2034	182	0,23
50 Bombardier Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.06.2033	53	0,07	510 AECOM, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2033	521	0,65
190 Capstone Copper Corp, 144A, 6,750 %, fällig 31.03.2033	196	0,25	500 Akumin Inc, 144A, 9,750 %, fällig 31.08.2031	483	0,61
170 Empire Communities Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.05.2029	176	0,22	1.130 Allen Media LLC / Allen Media Co-Issuer Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.02.2028	467	0,59
200 Toronto-Dominion Bank/The, 7,250 %, fällig 31.07.2084 *	209	0,26	240 Alpha Generation LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2032	250	0,31
120 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	121	0,15	180 AMC Networks Inc, 144A, 10,250 %, fällig 15.01.2029	193	0,24
380 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	372	0,47	460 American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	450	0,56
	2.914	3,66	50 American Axle & Manufacturing Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.10.2032	51	0,06
Frankreich – 1,66 % (28. Februar 2025: 3,01 %)			260 American Axle & Manufacturing Inc, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2033	264	0,33
183 Altice France SA, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2030	177	0,22	390 Amkor Technology Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.10.2033	398	0,50
511 Altice France SA, 144A, 6,500 %, fällig 15.04.2032	490	0,61	95 Anagram Holdings LLC/Anagram International Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.08.2026	–	–
210 BNP Paribas SA, 144A, 8,000 %, Ewige Anleihe *	230	0,29	210 Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.10.2033	213	0,27
400 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	426	0,54	170 APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	165	0,21
	1.323	1,66	140 APD ComputeCo LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2030	147	0,18
Deutschland – 0,87 % (28. Februar 2025: 0,73 %)			110 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029	110	0,14
70 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	72	0,09	100 Arbor Realty SR Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.12.2028	97	0,12
250 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	256	0,32	370 Arbor Realty SR Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.07.2030	341	0,43
190 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,500 %, fällig 24.03.2031	196	0,25	190 Arcosa Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.08.2032	199	0,25
170 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 23.04.2032	170	0,21	540 Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032	568	0,71
	694	0,87	140 Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2034	139	0,17
Hongkong – 0,62 % (28. Februar 2025: 0,59 %)			110 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	104	0,13
280 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 7,625 %, fällig 17.04.2032	293	0,37	30 Axon Enterprise Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2030	31	0,04
200 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 24.09.2033	200	0,25	450 Axon Enterprise Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2033	467	0,59
	493	0,62	200 Black Pearl Compute LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2031	205	0,26
Irland – 0,75 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			180 Block Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.08.2033	183	0,23
600 Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	599	0,75	370 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.07.2032	392	0,49
Israel – 1,74 % (28. Februar 2025: 1,54 %)			90 Capstone Borrower Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.06.2030	78	0,10
540 Teva Pharmaceutical Finance Co LLC, 6,150 %, fällig 01.02.2036	573	0,72	30 Carnival Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2029	30	0,04
710 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	816	1,02	160 Carnival Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2031	167	0,21
	1.389	1,74	550 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	570	0,72
			480 Carriage Purchaser Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2029	469	0,59
			530 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,500 %, fällig 01.06.2033	474	0,59

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	122	0,15	270 Gen Digital Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2033	269	0,34
800 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2036	813	1,02	120 Getty Images Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.11.2030	106	0,13
50 Celanese US Holdings LLC, 7,000 %, fällig 15.02.2031	52	0,06	220 GFL Environmental Holdings US Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2034	221	0,28
170 Celanese US Holdings LLC, 6,750 %, fällig 15.04.2033	174	0,22	460 Granite Ridge Resources Inc, 144A, 8,875 %, fällig 05.11.2029 †	444	0,56
390 Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	369	0,46	207 HCA Inc, 7,500 %, fällig 15.11.2095	225	0,28
260 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, fällig 01.04.2051	168	0,21	90 Herc Holdings Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2030	94	0,12
150 Chord Energy Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.10.2030	153	0,19	270 Herc Holdings Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2033	286	0,36
340 Chord Energy Corp, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2033	353	0,44	350 Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.07.2032	370	0,46
120 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	116	0,15	130 iHeartCommunications Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.05.2029	116	0,15
80 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	71	0,09	184 iHeartCommunications Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2031	139	0,17
520 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	500	0,63	120 Iron Mountain Information Management Services Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.07.2032	116	0,15
450 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	488	0,61	330 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	344	0,43
220 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 9,750 %, fällig 15.01.2034	232	0,29	130 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	131	0,16
140 Citigroup Inc, 6,625 %, Ewige Anleihe *	145	0,18	280 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.05.2033	288	0,36
270 Citigroup Inc, Series BB, 7,200 %, Ewige Anleihe *	280	0,35	290 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	301	0,38
70 Citigroup Inc, Series GG, 6,875 %, Ewige Anleihe *	72	0,09	130 JPMorgan Chase & Co, Series OO, 6,500 %, Ewige Anleihe *	136	0,17
180 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2030	189	0,24	310 Ladder Capital Finance Holdings LLLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2031	327	0,41
175 Clean Harbors Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.02.2031	180	0,23	190 Level 3 Financing Inc, 144A, 6,875 %, fällig 30.06.2033	197	0,25
260 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	275	0,35	230 Level 3 Financing Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2036	240	0,30
520 Cloud Software Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 30.09.2029	510	0,64	110 Life Time Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2031	113	0,14
140 Cloud Software Group Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.08.2033	132	0,17	440 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	470	0,59
400 Coinbase Global Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.10.2031	350	0,44	200 LifePoint Health Inc, 144A, 11,000 %, fällig 15.10.2030	217	0,27
80 Columbus McKinnon Corp/NY, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2033	82	0,10	180 Light & Wonder International Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2033	181	0,23
110 CoreWeave Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.06.2030	108	0,14	360 Madison IAQ LLC, 144A, 5,875 %, fällig 30.06.2029	359	0,45
40 CoreWeave Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.02.2031	39	0,05	170 Masterbrand Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2032	171	0,21
100 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.01.2033	99	0,12	1.592 McClatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031 †	1.799	2,26
520 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2034	538	0,67	50 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	52	0,06
810 CSC Holdings LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2029	513	0,64	500 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	500	0,63
320 CSC Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2030	124	0,16	240 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	241	0,30
230 CSC Holdings LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.11.2031	86	0,11	110 Michaels Cos Inc/The, 144A, 8,500 %, fällig 15.03.2033	107	0,13
110 Cushman & Wakefield US Borrower LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.09.2031	117	0,15	730 Michaels Cos Inc/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.03.2034	683	0,86
100 Diebold Nixdorf Inc, 144A, 7,750 %, fällig 31.03.2030	106	0,13	420 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 5,625 %, fällig 15.01.2030	408	0,51
170 Directv Financing LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.02.2030	170	0,21	380 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 7,422 %, fällig 15.01.2056 *	375	0,47
220 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	225	0,28	270 Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	277	0,35
480 Discovery Global Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	338	0,42	90 Millrose Properties Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2032	91	0,11
370 DISH DBS Corp, 7,750 %, fällig 01.07.2026 †	366	0,46	200 Miter Brands Acquisition Holdco Inc / MIWD Borrower LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.04.2032	202	0,25
630 DISH DBS Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.12.2028 †	612	0,77	170 MIWD Holdco II LLC / MIWD Finance Corp, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2030	159	0,20
130 DISH DBS Corp, 5,125 %, fällig 01.06.2029 †	116	0,15	110 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	108	0,14
270 DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig 15.11.2027 †	280	0,35	430 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	372	0,47
170 Diversified Healthcare Trust, 4,750 %, fällig 15.02.2028	166	0,21	300 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,500 %, fällig 15.03.2031	230	0,29
150 Diversified Healthcare Trust, 144A, 7,250 %, fällig 15.10.2030	156	0,20	110 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	118	0,15
170 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	154	0,19	250 Nabors Industries Inc, 144A, 8,875 %, fällig 15.08.2031	259	0,33
280 Dream Finders Homes Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.09.2030	287	0,36	50 NCL Corp Ltd, 1,125 %, fällig 15.02.2027	51	0,06
900 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029 †	983	1,23	40 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.01.2031	40	0,05
360 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	340	0,43	30 NCL Corp Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2033	30	0,04
360 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	386	0,48	320 NCR Atleos Corp, 144A, 9,500 %, fällig 01.04.2029	344	0,43
110 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2033	117	0,15	150 Neptune Bidco US Inc, 144A, 10,375 %, fällig 15.05.2031	152	0,19
180 Esab Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.04.2029	185	0,23	360 Neptune Bidco US Inc, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2033	353	0,44
140 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	139	0,17	501 New Generation Gas Gathering LLC, 144A, 9,410 %, fällig 30.09.2029 *†∞	521	0,65
120 FirstCash Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2032	124	0,16	110 Newell Brands Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.06.2028	116	0,15
260 Five Point Operating Co LP, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2030	269	0,34	230 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2033	235	0,30
250 Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	240	0,30	760 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Finco Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ≈≈	–	–
420 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	365	0,46	120 NRG Energy Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2034	122	0,15
170 Garrett Motion Holdings Inc / Garrett LX I Sarl, 144A, 7,750 %, fällig 31.05.2032	180	0,23	580 NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	591	0,74
160 Gates Corp/DE, 144A, 6,875 %, fällig 01.07.2029	166	0,21	170 Park-Ohio Industries Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.08.2030	177	0,22
190 Gee Automotive Holdings LLC, 144A, 7,250 %, fällig 01.03.2031	193	0,24	170 Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	171	0,22

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
176 Permian Resources Operating LLC, 144A, 9,875 %, fällig 15.07.2031	189	0,24	180 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	169	0,21
210 Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2032	221	0,28	60 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	53	0,07
70 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	73	0,09	310 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig 01.02.2032	329	0,41
290 Petco Health & Wellness Co Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.02.2031	283	0,36	960 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	840	1,05
940 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	880	1,10	100 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 7,500 %, fällig 01.05.2033	111	0,14
180 Primo Water Holdings Inc / Triton Water Holdings Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	180	0,23	30 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 7,750 %, fällig 01.05.2035	34	0,04
380 Qnity Electronics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2033	395	0,50	950 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	1.013	1,27
350 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	364	0,46	190 Versant Media Group Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.01.2031	195	0,24
335 Rackspace Finance LLC, 144A, 3,500 %, fällig 15.05.2028	138	0,17	240 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	250	0,31
280 Rivers Enterprise Borrower LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.10.2030	286	0,36	310 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	311	0,39
680 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	627	0,79	150 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	160	0,20
70 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2033	74	0,09	280 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2033	286	0,36
120 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	124	0,16	20 Voyager Technologies Inc, 144A, 0,750 %, fällig 15.11.2030	23	0,03
430 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 10,875 %, fällig 01.08.2029	441	0,55	200 WBI Operating LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.10.2033	203	0,26
380 Ryan Specialty LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2032	383	0,48	240 WESCO Distribution Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2034	242	0,30
380 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2032	395	0,50	270 WULF Compute LLC, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2030	286	0,36
100 Seagate Data Storage Technology Pte Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.07.2030	103	0,13	220 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	238	0,30
350 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	343	0,43	150 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2033	153	0,19
190 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029	184	0,23	110 XPO CNW Inc, 6,700 %, fällig 01.05.2034	119	0,15
110 Six Flags Entertainment Corp/Canada's Wonderland Co/Millennium Operations LLC, 144A, 8,625 %, fällig 15.01.2032	111	0,14	170 XPO Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2032	178	0,22
120 Smyrna Ready Mix Concrete LLC, 144A, 6,000 %, fällig 01.11.2028	120	0,15		56.382	70,76
370 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	390	0,49	Sambia – 2,07 % (28. Februar 2025: 2,50 %)		
390 Starwood Property Trust Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.04.2030	400	0,50	480 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	504	0,63
130 Stonex Escrow Issuer LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	135	0,17	690 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	737	0,93
110 StoneX Group Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.03.2031	117	0,15	200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2034	210	0,26
100 Summit Midstream Holdings LLC, 144A, 8,625 %, fällig 31.10.2029	105	0,13	200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2036	201	0,25
390 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2031	394	0,49		1.652	2,07
280 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2034	280	0,35	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 71.485 \$)		
117 Super Micro Computer Inc, 3,500 %, fällig 01.03.2029	109	0,14		70.138	88,03
400 SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	402	0,50	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,38 % (28. Februar 2025: 0,52 %)		
110 Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2036	113	0,14	Argentinien – 0,38 % (28. Februar 2025: 0,52 %)		
80 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 7,375 %, fällig 15.02.2029	83	0,10	377 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	300	0,38
170 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	172	0,22			
180 TEAM Services Holding Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.02.2033	176	0,22	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 176 \$)		
570 Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2033	589	0,74		300	0,38
180 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	181	0,23	Schuldscheindarlehen – 4,00 % (28. Februar 2025: 6,09 %)		
180 TKC Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.08.2030	184	0,23	247 Clarios Global LP, 6,172 %, fällig 06.05.2030 *	247	0,31
580 TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 31.01.2034	585	0,73	240 Dayforce Inc, 6,663 %, fällig 07.10.2032 *	222	0,28
180 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	183	0,23	400 DCert Buyer, Inc., 10,672 %, fällig 16.02.2029 *	324	0,41
70 TransDigm Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2033	71	0,09	272 Eyecare Tranche, 4,730 %, fällig 15.11.2028 *†	106	0,13
280 TransDigm Inc, 144A, 6,125 %, fällig 31.07.2034	285	0,36	4 Gray Television, 8,921 %, fällig 23.05.2029 *	4	0,01
530 Tutor Perini Corp, 144A, 11,875 %, fällig 30.04.2029	582	0,73	30 IntraFi Network, 7,672 %, fällig 31.07.2031 *	29	0,04
110 United Airlines Holdings Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2031	112	0,14	21 Magenta Buyer LLC, 10,677 %, fällig 27.07.2028 *	14	0,02
20 United Rentals North America Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2033	20	0,03	32 Peninsula Pacific Entertainment, 2,375 %, fällig 16.08.2032 *	32	0,04
380 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	399	0,50	134 Peninsula Pacific Entertainment, 8,422 %, fällig 16.08.2032 *	136	0,17
390 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2029	380	0,48	411 Phoenix Guarantor Inc, 6,172 %, fällig 21.02.2031 *	411	0,52
120 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, Series Feb, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2032	122	0,15	208 Quikrete Holdings Inc., 5,922 %, fällig 31.01.2032 *	208	0,26
190 Univision Communications Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.08.2028	195	0,25	354 Station Casinos LLC, 5,672 %, fällig 14.03.2031 *	354	0,44
370 Upbound Group Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2029	367	0,46	644 Upbound Group Inc, 6,418 %, fällig 19.08.2032 *	644	0,81
179 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	149	0,19	180 WW International Inc, 10,489 %, fällig 24.06.2030 *	154	0,19
			297 X Corp, 10,590 %, fällig 29.10.2029 *	298	0,37
			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 3.440 \$)		
				3.183	4,00
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,48 % (28. Februar 2025: 1,01 %)		
			1.979 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.979	2,48
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.979 \$)		
				1.979	2,48
			Stammaktien – 0,38 % (28. Februar 2025: 0,09 %)		
			Luxemburg – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			EUR 1 Altice France CVR t€	11	0,02
			EUR 10 Altice France Lux 3 t€	194	0,24
				205	0,26
			Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			2.640 Credit Suisse Group AG Escrow t∞	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
USA – 0,12 % (28. Februar 2025: 0,09 %)		
4 WW International Inc	96	0,12
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 608 \$)	301	0,38
Optionsscheine – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
USA – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
8 Spirit Aviation Holdings †∞	4	–
2 Spirit Aviation Holdings †∞	1	–
13 Spirit Aviation Holdings †∞	6	0,01
– Spirit Aviation Holdings †∞	–	–
	11	0,01
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 294 \$)	11	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 81.508 \$)	79.460	99,73
Credit Default Swaps – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,03 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1	–
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,01 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	–	–
Futures – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,08 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	34	0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	79.495	99,77
Credit Default Swaps – 0,00 % (28. Februar 2025: -0,03 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2	–
Devisenterminkontrakte: -0,03 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-22	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-24	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	79.471	99,74
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	205	0,26
Gesamtnettovermögen	79.676 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 63.569.000 \$ und machten 79,79 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ε Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

ABKÜRZUNGEN:

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

EUR – Euro

	% des Gesamtvermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,25
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,91
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,43
Finanzderivate	0,04
Sonstige Vermögenswerte	2,37
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf	Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Nabors Industries, Inc.	1,000 % – Verkauf	20. Jun. 2029	60	\$ -2
Goldman Sachs	Transocean Inc.	1,000 % – Kauf	20. Jun. 2029	60	1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 26 \$)					\$ 1
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -20 \$)					-2
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 6 \$)					\$ -1

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 187	Verkauf SGD 237	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf USD 131	Verkauf SGD 165	–
13. März 2026	BNY	Kauf SGD 10.338	Verkauf USD 8.188	-7
13. März 2026	BNY	Kauf SGD 282	Verkauf USD 223	–
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 24	Verkauf USD 34	-1
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 1.344	Verkauf USD 1.603	-14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 10 \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -5 \$)				-22
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 5 \$)				\$ -22

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Goldman Sachs	76	\$ 8.371
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 65 \$)			\$ 34
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)			–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 65 \$)			\$ 34

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 7,03 % (28. Februar 2025: 7,20 %)			Dominikanische Republik – 0,82 % (28. Februar 2025: 0,75 %)		
150 AGL CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class DR, 144A, 6,068 %, fällig 20.01.2035 *	143	0,37	300 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	317	0,82
140 AGL CLO 17 Ltd, Series 2022 17A, Class ER, 144A, 8,320 %, fällig 21.01.2035 *	132	0,34	Frankreich – 0,85 % (28. Februar 2025: 0,86 %)		
100 Apex Credit CLO 2019-II Ltd, Series 2019 2A, Class D1NR, 144A, 7,168 %, fällig 25.01.2038 *	100	0,26	343 Altice France SA, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	330	0,85
100 Capital Four US CLO Ltd, Series 2025 4A, Class E, 144A, 9,888 %, fällig 18.10.2038 *	100	0,26	Deutschland – 1,39 % (28. Februar 2025: 1,71 %)		
100 Dryden 113 CLO Ltd, Series 2022 113A, Class D1R3, 144A, 6,672 %, fällig 15.10.2037 *	100	0,26	40 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	41	0,11
150 GoldenTree Loan Management US CLO 16 Ltd, Series 2022 16A, Class DRR, 144A, 6,068 %, fällig 20.01.2038 *	149	0,38	200 CT Investment GmbH, 6,375 %, fällig 15.04.2030	244	0,63
150 Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd, Series 2024 76A, Class D1, 144A, 6,568 %, fällig 25.10.2037 *	151	0,39	250 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	253	0,65
160 Golub Capital Partners CLO 77 B Ltd, Series 2024 77A, Class E, 144A, 8,518 %, fällig 25.01.2038 *	161	0,42		538	1,39
150 Katayma CLO II Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	152	0,39	Guatemala – 0,76 % (28. Februar 2025: 0,88 %)		
250 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class ER, 144A, 11,504 %, fällig 15.10.2034 *	237	0,61	60 Central American Bottling Corp / CBC Bottling Holdco SL / Beliv Holdco SL, 144A, 5,250 %, fällig 27.04.2029 *	59	0,16
150 Ocean Trails CLO XIV Ltd, Series 2023 14A, Class ER, 144A, 10,008 %, fällig 20.01.2038 *	145	0,38	250 Millicom International Cellular SA, 4,500 %, fällig 27.04.2031	234	0,60
150 OCP CLO 2023-26 Ltd, Series 2023 26A, Class ER, 144A, 8,118 %, fällig 17.04.2037 *	151	0,39		293	0,76
150 OHA Credit Funding 11 Ltd, Series 2022 11A, Class D1R, 144A, 6,518 %, fällig 19.07.2037 *	151	0,39	Hongkong – 0,68 % (28. Februar 2025: 0,64 %)		
100 OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class D1, 144A, 7,118 %, fällig 20.04.2037 *	101	0,26	142 Add Hero Holdings Ltd, 8,500 %, fällig 30.09.2029	7	0,02
100 Palmer Square CLO 2022-3 Ltd, Series 2022 3A, Class D1R, 144A, 6,618 %, fällig 20.07.2037 *	101	0,26	116 Add Hero Holdings Ltd, 9,000 %, fällig 30.09.2030	2	–
100 Pikes Peak CLO 6, Series 2020 6A, Class ERR, 144A, 8,255 %, fällig 18.05.2034 *	100	0,26	153 Add Hero Holdings Ltd, 9,800 %, fällig 30.09.2031	2	–
100 PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.04.2038 *	100	0,26	260 Melco Resorts Finance Ltd, 5,375 %, fällig 04.12.2029	254	0,66
150 RR 18 Ltd, Series 2021 18A, Class DR, 144A, 8,572 %, fällig 15.07.2040 *	145	0,37		265	0,68
100 Trinitas CLO XXVII Ltd, Series 2024 27A, Class D1, 144A, 7,968 %, fällig 18.04.2037 *	101	0,26	Irland – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,70 %)		
200 Warwick Capital CLO 3 Ltd, Series 2024 3A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	202	0,52	200 Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	200	0,51
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 2.750 \$)	2.722	7,03	Israel – 1,19 % (28. Februar 2025: 1,46 %)		
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,25 %)			400 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 8,125 %, fällig 15.09.2031	460	1,19
100 LHOME Mortgage Trust 2025-RTL1, Series 2025 RTL1, Class M1, 144A, 7,023 %, fällig 25.01.2040 *	102	0,26	Italien – 1,90 % (28. Februar 2025: 1,41 %)		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 100 \$)	102	0,26	520 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 4,198 %, fällig 01.06.2032 *	503	1,30
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 75,77 % (28. Februar 2025: 70,72 %)			EUR 100 TeamSystem SpA, 5,516 %, fällig 31.07.2031 *	112	0,29
Belgien – 0,31 % (28. Februar 2025: 0,26 %)			EUR 100 Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 30.09.2030	119	0,31
EUR 100 Azelis Finance NV, 4,750 %, fällig 25.09.2029	122	0,31		734	1,90
Brasilien – 2,70 % (28. Februar 2025: 1,96 %)			Kasachstan – 0,49 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
450 B3 SA – Brasil Bolsa Balcão, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	426	1,10	200 Tengizchevroil Finance Co International Ltd, 144A, 3,250 %, fällig 15.08.2030	188	0,49
450 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	421	1,09	Luxemburg – 1,33 % (28. Februar 2025: 2,24 %)		
200 Nova Securitisation Sarl, 144A, 5,750 %, fällig 03.02.2031	198	0,51	630 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	437	1,13
	1.045	2,70	82 Altice France Lux 3 / Altice Holdings 1, 144A, 10,000 %, fällig 15.01.2033	77	0,20
Kanada – 0,95 % (28. Februar 2025: 1,51 %)				514	1,33
20 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	16	0,04	Mexiko – 2,31 % (28. Februar 2025: 2,80 %)		
190 Bombardier Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.07.2031	202	0,52	360 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 6,625 %, Ewige Anleihe *	358	0,92
60 Capstone Copper Corp, 144A, 6,750 %, fällig 31.03.2033	62	0,16	400 BBVA Mexico SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero BBVA Mexico/TX, 144A, 5,125 %, fällig 18.01.2033 *	399	1,03
90 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	88	0,23	200 Grupo Televisa SAB, 5,000 %, fällig 13.05.2045	137	0,36
	368	0,95		894	2,31
Chile – 0,72 % (28. Februar 2025: 0,67 %)			Niederlande – 1,70 % (28. Februar 2025: 0,72 %)		
200 ATP Tower Holdings / Andean Telecom Partners Chile SpA / Andean Tower Partners C, 144A, 7,875 %, fällig 03.02.2030	207	0,53	EUR 100 Boels Topholding BV, 5,750 %, fällig 15.05.2030	122	0,31
70 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	73	0,19	200 Sunrise FinCo I BV, 4,875 %, fällig 15.07.2031	191	0,49
	280	0,72	EUR 130 VZ Secured Financing BV, 5,250 %, fällig 15.01.2033	151	0,39
China – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,01 %)			200 VZ Secured Financing BV, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2033	197	0,51
18 China Aoyuan Group Ltd, Nullkupon, fällig 30.09.2028	–	–		661	1,70
56 China Aoyuan Group Ltd, 5,500 %, fällig 30.09.2031 †	–	–	Peru – 0,66 % (28. Februar 2025: 0,67 %)		
201 China Aoyuan Group Ltd, 0,000 %, Ewige Anleihe †	2	0,01	350 Petroleos del Peru SA, 144A, 4,750 %, fällig 19.06.2032	256	0,66
	2	0,01	Schweden – 0,87 % (28. Februar 2025: 1,31 %)		
Kolumbien – 1,34 % (28. Februar 2025: 1,04 %)			EUR 280 Verisure Holding AB, 7,125 %, fällig 01.02.2028	339	0,87
150 Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig 19.01.2036	154	0,40	Schweiz – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,64 %)		
200 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	151	0,39	220 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	225	0,58
200 Grupo Nutresa SA, 144A, 8,000 %, fällig 12.05.2030	216	0,55	Türkei – 1,24 % (28. Februar 2025: 1,65 %)		
	521	1,34	200 Coca-Cola Icecek AS, 144A, 4,500 %, fällig 20.01.2029	198	0,51
			270 Türk Telekomunikasyon AS, 144A, 7,375 %, fällig 20.05.2029	283	0,73
				481	1,24
			Vereinigtes Königreich – 6,14 % (28. Februar 2025: 6,33 %)		
			GBP 200 Ashtead Capital Inc, 144A, 2,450 %, fällig 12.08.2031	181	0,47
			100 B&M European Value Retail plc, 4,000 %, fällig 15.11.2028	131	0,34
			40 Brightstar Lottery Plc/ Brightstar Global Solutions Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2033	40	0,10
			GBP 100 Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030	137	0,35
			200 Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 11,500 %, fällig 15.08.2029	205	0,53
			EUR 100 INEOS Quattro Finance 2 Plc, 6,750 %, fällig 15.04.2030	100	0,26

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Vereinigtes Königreich – (Fortsetzung)					
GBP	280	Lloyds Banking Group Plc, 8,000 %, Ewige Anleihe *	304	0,79	
	225	Marks & Spencer Plc, 144A, 7,125 %, fällig 01.12.2037	253	0,65	
	510	Marston's Issuer Plc, Series B1, 6,413 %, fällig 16.07.2035 *	651	1,68	
EUR	100	RAY Financing LLC, 6,500 %, fällig 15.07.2031	122	0,31	
	270	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2033	256	0,66	
			2.380	6,14	
Vereinigte Republik Tansania – 0,53 % (28. Februar 2025: 0,50 %)					
	200	HTA Group Ltd/Mauritius, 144A, 7,500 %, fällig 04.06.2029	207	0,53	
USA – 43,49 % (28. Februar 2025: 35,87 %)					
	200	1261229 BC Ltd, 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2032	207	0,53	
	40	AAR Escrow Issuer LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2029	41	0,11	
	30	Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig am 01.07.2032	29	0,08	
	90	Advanced Drainage Systems Inc, 144A, 5,375 %, fällig 01.03.2034	91	0,23	
	110	AECOM, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2033	112	0,29	
	50	Alpha Generation LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2032	52	0,13	
	80	AMC Networks Inc, 144A, 10,250 %, fällig 15.01.2029	86	0,22	
	30	American Airlines Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2028	31	0,08	
	130	American Axle & Manufacturing Inc, 5,000 %, fällig 01.10.2029	127	0,33	
	30	American Axle & Manufacturing Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.10.2032	31	0,08	
	130	American Axle & Manufacturing Inc, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2033	132	0,34	
	100	Amkor Technology Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.10.2033	102	0,26	
	110	Antero Midstream Partners LP / Antero Midstream Finance Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.10.2033	112	0,29	
	90	APH Somerset Investor 2 LLC / APH2 Somerset Investor 2 LLC / APH3 Somerset Inves, 144A, 7,875 %, fällig 01.11.2029	87	0,23	
	70	APLD ComputeCo LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2030	74	0,19	
	50	Arbor Realty SR Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.12.2028	49	0,13	
	90	Arbor Realty SR Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.07.2030	83	0,21	
	30	Arcosa Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.08.2032	31	0,08	
	240	Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032	252	0,65	
	70	Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2034	70	0,18	
	40	Axon Enterprise Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2030	41	0,11	
	20	Axon Enterprise Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2033	21	0,05	
	180	Bausch Health Americas Inc, 144A, 8,500 %, fällig 31.01.2027	179	0,46	
	60	Black Pearl Compute LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2031	61	0,16	
	50	Block Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.08.2033	51	0,13	
	40	Capstone Borrower Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.06.2030	35	0,09	
	100	Carnival Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2029	101	0,26	
	80	Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	83	0,21	
	500	Carnival Plc, 1,000 %, fällig 28.10.2029	551	1,42	
	100	Carnival Plc, 4,125 %, fällig 15.07.2031	122	0,31	
	150	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 15.01.2034	131	0,34	
	120	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2036	122	0,31	
	40	Celanese US Holdings LLC, 7,000 %, fällig 15.02.2031	41	0,11	
	150	Charles Schwab Corp/The, Series H, 4,000 %, Ewige Anleihe *	142	0,37	
	300	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,700 %, fällig 01.04.2051	194	0,50	
	410	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,850 %, fällig 01.04.2061	248	0,64	
	80	Chord Energy Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.10.2030	82	0,21	
	160	Chord Energy Corp, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2033	166	0,43	
	100	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	97	0,25	
	40	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2030	35	0,09	
	200	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	217	0,56	
	100	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 9,750 %, fällig 15.01.2034	105	0,27	
	70	Citigroup Inc, 6,625 %, Ewige Anleihe *	72	0,19	
	30	Citigroup Inc, Series GG, 6,875 %, Ewige Anleihe *	31	0,08	
	50	Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 6,750 %, fällig 15.02.2030	52	0,14	
	80	Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	85	0,22	
	140	Cloud Software Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 30.09.2029	137	0,35	
	120	Cloud Software Group Inc, 144A, 8,250 %, fällig 30.06.2032	120	0,31	
	70	Cloud Software Group Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.08.2033	66	0,17	
	40	Columbus McKinnon Corp/NY, 144A, 7,125 %, fällig 01.02.2033	41	0,11	
	60	CoreWeave Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.06.2030	59	0,15	
	10	CoreWeave Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.02.2031	10	0,03	
	240	Crescent Energy Finance LLC, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2034	248	0,64	
	200	CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	143	0,37	
	250	CSC Holdings LLC, 144A, 3,375 %, fällig 15.02.2031	149	0,39	
	400	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	240	0,62	
	10	Directv Financing LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.02.2030	10	0,03	
	80	Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	82	0,21	
	120	Discovery Global Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	85	0,22	
	130	DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig 15.11.2027 †	135	0,35	
	80	Diversified Healthcare Trust, 144A, 7,250 %, fällig 15.10.2030	83	0,21	
	100	Diversified Healthcare Trust, 4,375 %, fällig 01.03.2031	91	0,23	
	100	Dream Finders Homes Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.09.2030	102	0,26	
	500	EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029 †	546	1,41	
	17	EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030 †	60	0,15	
	140	EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030 †	142	0,37	
	10	EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	11	0,03	
	220	EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,000 %, fällig 15.03.2033	234	0,60	
	100	Five Point Operating Co LP, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2030	104	0,27	
	200	Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	174	0,45	
	90	Garrett Motion Holdings Inc / Garrett LX I Sarl, 144A, 7,750 %, fällig 31.05.2032	95	0,25	
	90	Gee Automotive Holdings LLC, 144A, 7,250 %, fällig 01.03.2031	92	0,24	
	60	Gen Digital Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2033	60	0,15	
	60	Getty Images Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.11.2030	53	0,14	
	50	GFL Environmental Holdings US Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2034	50	0,13	
	230	Granite Ridge Resources Inc, 144A, 8,875 %, fällig 05.11.2029 †	222	0,57	
	30	Herc Holdings Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2030	31	0,08	
	50	Herc Holdings Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2033	53	0,14	
	100	Herc Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.03.2034	101	0,26	
	10	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.07.2032	11	0,03	
	160	Howard Midstream Energy Partners LLC, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2034	165	0,43	
	76	iHeartCommunications Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.05.2029	68	0,17	
	110	Iron Mountain Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2034	129	0,33	
	30	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	31	0,08	
	150	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.05.2033	154	0,40	
	120	JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	124	0,32	
	60	JPMorgan Chase & Co, Series OO, 6,500 %, Ewige Anleihe *	63	0,16	
	20	Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 14.06.2030	21	0,05	
	40	Level 3 Financing Inc, 144A, 6,875 %, fällig 30.06.2033	41	0,11	
	160	Level 3 Financing Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2036	167	0,43	
	40	Life Time Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2031	41	0,11	
	130	LifePoint Health Inc, 144A, 10,000 %, fällig 01.06.2032	136	0,35	
	60	Light & Wonder International Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2033	60	0,16	
	50	Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	53	0,14	
	30	Masterbrand Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2032	30	0,08	
	60	Michaels Cos Inc/The, 144A, 8,500 %, fällig 15.03.2033	58	0,15	
	350	Michaels Cos Inc/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.03.2034	327	0,84	
	200	Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 7,422 %, fällig 15.01.2056 *	197	0,51	
	150	Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	154	0,40	
	40	Millrose Properties Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2032	41	0,10	
	100	Miter Brands Acquisition Holdco Inc / MIWD Borrower LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.04.2032	101	0,26	
	60	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	59	0,15	
	40	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	35	0,09	
	50	MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	54	0,14	
	180	NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	185	0,48	
	80	Neptune Bidco US Inc, 144A, 10,375 %, fällig 15.05.2031	81	0,21	

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 12,56 % (28. Februar 2025: 17,88 %)		
USA – (Fortsetzung)			Angola – 0,84 % (28. Februar 2025: 0,72 %)		
120 Neptune Bidco US Inc, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2033	118	0,30	330 Angola, Internationale Staatsanleihe, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	324	0,84
50 Newell Brands Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.06.2028	53	0,14	Argentinien – 2,35 % (28. Februar 2025: 3,60 %)		
120 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2033	123	0,32	454 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 4,125 %, fällig 09.07.2035	344	0,88
240 NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	244	0,63	267 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	212	0,55
90 Park-Ohio Industries Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.08.2030	94	0,24	340 Provincia de Cordoba, 144A, 9,750 %, fällig 02.07.2032	356	0,92
90 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	93	0,24		912	2,35
90 Petco Health & Wellness Co Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.02.2031	88	0,23	Bahrain – 0,70 % (28. Februar 2025: 0,65 %)		
346 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	324	0,84	310 Internationale Anleihe der Regierung von Bahrain, 144A, 6,000 %, fällig 19.09.2044	271	0,70
90 Qnity Electronics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2033	94	0,24	Costa Rica – 0,54 % (28. Februar 2025: 0,50 %)		
180 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	187	0,48	200 Internationale Anleihe der Regierung von Costa Rica, 6,125 %, fällig 19.02.2031	210	0,54
265 Rackspace Finance LLC, 144A, 3,500 %, fällig 15.05.2028	109	0,28	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 1,55 % (28. Februar 2025: 0,91 %)		
90 Rivers Enterprise Borrower LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.10.2030	92	0,24	410 Côte d'Ivoire, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,125 %, fällig 15.06.2033	409	1,06
30 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2033	32	0,08	200 Côte d'Ivoire, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,750 %, fällig 25.02.2041	191	0,49
90 Sally Holdings LLC / Sally Capital Inc, 6,750 %, fällig 01.03.2032	93	0,24		600	1,55
60 Six Flags Entertainment Corp/Canada's Wonderland Co/Millennium Operations LLC, 144A, 8,625 %, fällig 15.01.2032	61	0,16	Dominikanische Republik – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,87 %)		
90 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	95	0,24	230 Internationale Anleihe der Dominikanischen Republik, 144A, 4,500 %, fällig 30.01.2030	226	0,58
70 Stonex Escrow Issuer LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	73	0,19	Ecuador – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,60 %)		
50 Summit Midstream Holdings LLC, 144A, 8,625 %, fällig 31.10.2029	52	0,14	234 Internationale Anleihe der Regierung von Ecuador, 144A, Nullkupon, fällig 31.07.2030	197	0,51
100 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2031	101	0,26	Ägypten – 0,95 % (28. Februar 2025: 1,54 %)		
140 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2034	140	0,36	350 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 144A, 7,600 %, fällig 01.03.2029	369	0,95
260 SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	261	0,67	Jordanien – 0,65 % (28. Februar 2025: 1,10 %)		
60 Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2036	62	0,16	240 Jordanien, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	251	0,65
80 TEAM Services Holding Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.02.2033	78	0,20	Nigeria – 0,81 % (28. Februar 2025: 1,51 %)		
230 Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2033	238	0,61	300 Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,875 %, fällig 16.02.2032	314	0,81
90 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	90	0,23	Oman – 0,57 % (28. Februar 2025: 0,51 %)		
90 TKC Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.08.2030	92	0,24	200 Oman, Internationale Staatsanleihe, 6,750 %, fällig 17.01.2048	221	0,57
100 TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 31.01.2034	101	0,26	Senegal – 0,34 % (28. Februar 2025: 0,38 %)		
140 TransDigm Inc, 144A, 6,125 %, fällig 31.07.2034	142	0,37	230 Internationale Anleihe der senegalesischen Regierung, 144A, 6,750 %, fällig 13.03.2048	131	0,34
170 Tutor Perini Corp, 144A, 11,875 %, fällig 30.04.2029	187	0,48	Südafrika – 1,06 % (28. Februar 2025: 0,47 %)		
50 United Airlines Holdings Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2031	51	0,13	200 Republik Südafrika, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,125 %, fällig 11.12.2037	197	0,51
190 United Rentals North America Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2033	192	0,49	250 Republik Südafrika, Internationale Staatsanleihe, Series 30Y, 5,650 %, 5,750 %, fällig 27.09.2047	212	0,55
140 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2029	136	0,35		409	1,06
60 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, Series Feb, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2032	61	0,16	Türkei – 0,59 % (28. Februar 2025: 1,89 %)		
220 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig 01.02.2032	233	0,60	300 Türkei, Internationale Staatsanleihe, Series 30Y, 4,875 %, fällig 16.04.2043	230	0,59
320 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	280	0,72	Ukraine – 0,52 % (28. Februar 2025: 0,49 %)		
50 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 7,500 %, fällig 01.05.2033	55	0,14	12 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2030	8	0,02
70 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.06.2034	74	0,19	44 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2034	22	0,06
20 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 7,750 %, fällig 01.05.2035	23	0,06	97 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 4,500 %, fällig 01.02.2034	61	0,16
80 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	85	0,22	37 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2035	21	0,05
70 Versant Media Group Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.01.2031	72	0,19	76 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 4,500 %, fällig 01.02.2035	46	0,12
90 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	94	0,24	31 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 0,000 %, fällig 01.02.2036	18	0,04
140 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2033	143	0,37	43 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 144A, 4,500 %, fällig 01.02.2036	26	0,07
50 Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 15.02.2029	50	0,13		202	0,52
100 WBI Operating LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.10.2033	102	0,26	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.948 \$)		
120 WESCO Distribution Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2034	121	0,31		4.867	12,56
100 WULF Compute LLC, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2030	106	0,27	Schuldscheindarlehen – 3,47 % (28. Februar 2025: 3,10 %)		
170 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	184	0,47	60 AthenaHealth Group Inc, 6,422 %, fällig 15.02.2029 *	59	0,15
	16.858	43,49	50 Cloudera Inc, 7,566 %, fällig 10.10.2028 *	44	0,11
Sambia – 2,30 % (28. Februar 2025: 2,20 %)			96 Hexion Holdings Corp, 7,677 %, fällig 15.03.2029 *	94	0,24
450 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	481	1,24	20 IntraFi Network, 7,672 %, fällig 31.07.2031 *	19	0,05
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2034	209	0,54	110 Jane Street Group LLC, 5,822 %, fällig 15.12.2031 *	107	0,28
200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2036	201	0,52	60 Kodiak BP LLC, 7,422 %, fällig 04.12.2031 *	60	0,16
	891	2,30	90 Petco Health & Wellness Co Inc, 7,921 %, fällig 22.01.2031 *	87	0,22
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 30.024 \$)			99 Quikrete Holdings Inc., 5,922 %, fällig 31.01.2032 *	99	0,26
	29.369	75,77			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Schuldscheindarlehen – (Fortsetzung)			Devisenterminkontrakte – -0,04 % (28. Februar 2025: -0,16 %)		
197 Station Casinos LLC, 5,672 %, fällig 14.03.2031 *	197	0,51	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
100 Team Services Holding Inc, 0,000 %, fällig 31.01.2033 *	95	0,24	Futures – -0,10 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
196 TK Elevator U.S. Newco Inc, 6,377 %, fällig 30.04.2030 *	196	0,51	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
162 VVV International Inc, 10,489 %, fällig 24.06.2030 *	139	0,36	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
148 X Corp, 10,590 %, fällig 29.10.2029 *	149	0,38	-56 -0,14		
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 1.357 \$)	1.345	3,47	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Stammaktien – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			38.691 99,83		
China – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
HKD 50 China Aoyuan Group Ltd †	1	–	68 0,17		
Luxemburg – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Gesamtvermögen		
EUR – Altice France CVR †	6	0,02	38.759 \$ 100,00		
EUR 6 Altice France Lux 3 †	106	0,27			
	112	0,29			
Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
1.680 Credit Suisse Group AG Escrow †	–	–			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)	113	0,29			
Real Estate Investment Trusts – 0,45 % (28. Februar 2025: 0,45 %)					
USA – 0,45 % (28. Februar 2025: 0,45 %)					
4 AGNC Investment Corp, Series F *	97	0,25			
1 Chimera Investment Corp, Series C *	27	0,07			
2 MFA Financial Inc, Series C *	51	0,13			
	175	0,45			
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 180 \$)	175	0,45			
Optionsscheine – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
USA – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
4 Spirit Aviation Holdings †	2	0,01			
1 Spirit Aviation Holdings †	1	–			
7 Spirit Aviation Holdings †	3	0,01			
– Spirit Aviation Holdings †	–	–			
	6	0,02			
Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 155 \$)	6	0,02			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 39.514 \$)	38.699	99,85			
Devisenterminkontrakte – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,10 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	33	0,08			
Futures – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,14 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	15	0,04			
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	38.747	99,97			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 11	Verkauf AUD 16	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf USD 35	Verkauf SGD 44	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1	Verkauf SGD 2	–
13. März 2026	BNY	Kauf SGD 81	Verkauf USD 65	–
13. März 2026	BNY	Kauf SGD 3.654	Verkauf USD 2.894	-2
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 315	Verkauf USD 432	-7
13. März 2026	BNY	Kauf EUR –	Verkauf USD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 703	Verkauf USD 838	-8
13. März 2026	BNY	Kauf AUD 4.694	Verkauf USD 3.326	13
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf USD 162	Verkauf GBP 120	–
16. Apr. 2026	Citi	Kauf EUR 1.847	Verkauf USD 2.168	20
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 39 \$)				\$ 33
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -65 \$)				-17
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -26 \$)				\$ 16

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro FX Currency März 2026	UBS -23	\$ -3.401	\$ -39
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	UBS 33	3.635	15
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 57 \$)			\$ 15
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): - \$)			-39
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 57 \$)			\$ -24

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 7,92 % (28. Februar 2025: 4,54 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,53 % (28. Februar 2025: 2,82 %)		
Frankreich – 3,87 % (28. Februar 2025: 3,07 %)			653 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)		
SGD 6.000 Credit Agricole SA, 3,800 %, fällig 30.04.2031 *	4.764	3,87	653	0,53	
Singapur – 1,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 653 \$)		
SGD 2.000 Netlink Treasury Pte Ltd, 2,650 %, fällig am 03.09.2035	1.584	1,29	653	0,53	
Supranational – 2,76 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 125.963 \$)		
INR 100.000 Asian Development Bank, 6,200 %, fällig 06.10.2026	1.097	0,89	121.519	98,75	
INR 210.000 European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig 26.10.2027	2.296	1,87	Devisenterminkontrakte – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
	3.393	2,76	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.376 \$)			251	0,20	
9.741	7,92		Futures – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,01 %)		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 90,30 % (28. Februar 2025: 91,47 %)			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
China – 21,87 % (28. Februar 2025: 19,56 %)			28	0,02	
CNY 62.200 Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	9.657	7,84	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
CNH 43.500 Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	6.890	5,60	121.798	98,97	
CNY 24.900 Chinesische Staatsanleihe, Serie INBK, 3,120 %, fällig 25.10.2052	4.194	3,41	Devisenterminkontrakte – -0,07 % (28. Februar 2025: -0,09 %)		
CNY 40.000 Export-Import Bank of China/The, Series 2010, 3,230 %, fällig 23.03.2030	6.176	5,02	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	26.917	21,87	-88	-0,07	
Hongkong – 0,86 % (28. Februar 2025: 0,66 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
HKD 8.000 Hongkong, Internationale Staatsanleihe, 3,850 %, fällig 10.06.2055	1.062	0,86	-88	-0,07	
Indien – 11,15 % (28. Februar 2025: 12,32 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
INR 80.000 Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	903	0,73	121.710	98,90	
INR 150.000 Indische Staatsanleihe, 7,610 %, fällig 09.05.2030	1.728	1,40	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
INR 20.000 Indien, Staatsanleihe, 5,770 %, fällig 03.08.2030	215	0,18	1.348	1,10	
INR 50.000 Indien, Staatsanleihe, 6,100 %, fällig 12.07.2031	542	0,44	Gesamt Nettovermögen		
INR 190.000 Indische Staatsanleihe, 6,570 %, fällig 05.12.2033	2.078	1,69	123.058 \$	100,00	
INR 100.000 Indische Staatsanleihe, 6,220 %, fällig 16.03.2035	1.064	0,87			
INR 250.000 Indische Staatsanleihe, 7,180 %, fällig 24.07.2037	2.824	2,29			
INR 300.000 Indische Staatsanleihe, 7,300 %, fällig 19.06.2053	3.273	2,66			
INR 100.000 Indische Staatsanleihe, 7,240 %, fällig 18.08.2055	1.091	0,89			
	13.718	11,15			
Indonesien – 8,19 % (28. Februar 2025: 7,18 %)					
IDR 41.000.000 Indonesien, Schatzanleihe, Serie 104, 6,500 %, fällig 15.07.2030	2.520	2,05			
IDR 49.000.000 Indonesien, Schatzanleihe, Serie FR98, 7,125 %, fällig 15.06.2038	3.054	2,48			
IDR 71.585.000 Indonesische Schatzanleihe, Serie FR97, 7,125 %, fällig 15.06.2043	4.503	3,66			
	10.077	8,19			
Malaysia – 13,46 % (28. Februar 2025: 14,84 %)					
MYR 6.100 Malaysia, Staatsanleihe, Series 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	1.582	1,28			
MYR 48.870 Malaysische Staatsanleihe, Serie 0318, 4,642 %, fällig 07.11.2033	13.533	11,00			
MYR 5.560 Malaysia, Staatsanleihe, Serie 0120, 4,065 %, fällig 15.06.2050	1.447	1,18			
	16.562	13,46			
Philippinen – 7,79 % (28. Februar 2025: 6,68 %)					
PHP 549.000 Internationale Anleihe der philippinischen Regierung, 6,250 %, fällig 14.01.2036	9.591	7,79			
Singapur – 5,80 % (28. Februar 2025: 4,89 %)					
SGD 2.250 Housing & Development Board, 2,471 %, fällig 21.01.2036	1.812	1,47			
SGD 2.750 Public Utilities Board, 2,486 %, fällig 15.10.2055	2.049	1,67			
SGD 2.500 Singapur, Staatsanleihe, 2,375 %, fällig 01.07.2039	2.057	1,67			
SGD 1.500 Singapur, Staatsanleihe, 2,250 %, fällig 01.07.2040	1.216	0,99			
	7.134	5,80			
Südkorea – 12,37 % (28. Februar 2025: 15,84 %)					
KRW 3.500.000 Koreanische Staatsanleihe, Serie 2912, 1,375 %, fällig 10.12.2029	2.277	1,85			
KRW 3.500.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	2.249	1,83			
KRW 5.500.000 Koreanische Staatsanleihe, Serie 3206, 3,375 %, fällig 10.06.2032	3.820	3,10			
KRW 8.000.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	4.146	3,37			
KRW 4.100.000 Koreanische Schatzanleihe, Serie 5403, 3,250 %, fällig 10.03.2054	2.731	2,22			
	15.223	12,37			
Thailand – 8,81 % (28. Februar 2025: 9,50 %)					
THB 294.730 Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	10.841	8,81			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 115.934 \$)					
111.125	90,30				

– 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 2026.

ABKÜRZUNGEN:

CNY	– Chinesischer Renminbi
CNH	– 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	97,65
Organismen für gemeinsame Anlagen	0,53
Finanzderivate	0,23
Sonstige Vermögenswerte	1,59
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	103	Verkauf	AUD	145	\$	-1
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	108	Verkauf	EUR	91		1
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	9	Verkauf	SGD	10		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	3	Verkauf	SGD	4		–
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	2.489	Verkauf	USD	1.971		-1
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	34	Verkauf	USD	27		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	3	Verkauf	USD	4		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	336	Verkauf	USD	401		-4
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH	1.029	Verkauf	USD	150		–
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH	81.113	Verkauf	USD	11.754		80
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	10.501	Verkauf	USD	7.444		28
16. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	CNH	26.700	Verkauf	USD	3.817		79
27. März 2026	JP Morgan	Kauf	AUD	3.630	Verkauf	NZD	4.200		61
14. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	2.636	Verkauf	PHP	157.000		-82
29. Mai. 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	SGD	3.090	Verkauf	USD	2.457		2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 89 \$)								\$	251
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -176 \$)									-88
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -87 \$)								\$	163

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
Korea 3 Year Bond März 2026	UBS	92	\$ 6.750	\$	28
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 21 \$)				\$	28
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)					–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 21 \$)				\$	28

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 98,16 % (28. Februar 2025: 94,88 %)				Spanien – 3,42 % (28. Februar 2025: 2,74 %)				
Australien – 1,36 % (28. Februar 2025: 1,21 %)				EUR	1.900	Aena SME SA, 4,250 %, fällig 13.10.2030	2.378	1,30
EUR	1.400	National Australia Bank Ltd, Series emtN, 3,125 %, fällig 28.02.2030		EUR	800	Aena SME SA, 3,500 %, fällig 22.01.2036	949	0,52
EUR	720	Optus Finance Pty Ltd, 1,000 %, fällig 20.06.2029	1.680		2.000	Banco Santander SA, 5,294 %, fällig 18.08.2027	2.036	1,12
			803	EUR	700	Banco Santander SA, 4,250 %, fällig 12.06.2030	873	0,48
			2.483				6.236	3,42
			1,36	Schweden – 1,36 % (28. Februar 2025: 2,35 %)				
Belgien – 1,91 % (28. Februar 2025: 0,96 %)				EUR	2.190	Hemso Treasury Oyj, 0,000 %, fällig 19.01.2028	2.469	1,36
EUR	1.600	Anheuser-Busch InBev SA/NV, 3,450 %, fällig 22.09.2031	1.942	Schweiz – 2,40 % (28. Februar 2025: 3,15 %)				
EUR	900	FLUVIUS System Operator CV, 3,500 %, fällig 12.03.2035	1.065	EUR	1.050	Sika Capital BV, 3,750 %, fällig 03.05.2030	1.284	0,70
EUR	400	Warehouses De Pauw CVA, 3,125 %, fällig 15.01.2031	473	EUR	1.680	UBS Group AG, 3,125 %, fällig 13.02.2031 *	1.991	1,09
			3.480		920	UBS Group AG, 144A, 4,588 %, fällig 10.08.2032 *	924	0,51
			1,91	EUR	180	UBS Group AG, 0,625 %, fällig 18.01.2033	177	0,10
Kanada – 3,74 % (28. Februar 2025: 1,70 %)							4.376	2,40
GBP	1.760	Bank of Montreal, 4,875 %, fällig 01.10.2031 *	2.412	Vereinigtes Königreich – 10,42 % (28. Februar 2025: 12,08 %)				
GBP	500	Royal Bank of Canada, 5,000 %, fällig 24.01.2028	686	GBP	1.070	British Land Co Plc/The, 2,375 %, fällig 14.09.2029	1.347	0,74
EUR	3.140	Toronto-Dominion Bank/The, 3,357 %, fällig 22.09.2032	3.718	GBP	620	British Land Co Plc/The, 5,250 %, fällig 14.04.2032	860	0,47
			6.816	EUR	1.500	Coventry Building Society, 3,125 %, fällig 29.10.2029	1.793	0,99
			3,74		200	Diageo Investment Corp, 5,125 %, fällig 15.08.2030	208	0,12
Dänemark – 1,93 % (28. Februar 2025: 1,21 %)				EUR	1.200	GSK Capital BV, 3,125 %, fällig 28.11.2032	1.425	0,78
EUR	930	Danske Bank A/S, 3,250 %, fällig 14.01.2033 *	1.109	GBP	300	HSBC Holdings Plc, 3,000 %, fällig 22.07.2028 *	398	0,22
EUR	2.030	Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 2,875 %, fällig 27.08.2030	2.410		600	HSBC Holdings Plc, 6,161 %, fällig 09.03.2029 *	624	0,34
			3.519	EUR	310	Lloyds Banking Group Plc, 3,125 %, fällig 24.08.2030 *	370	0,20
			1,93		1.400	Lloyds Banking Group Plc, 4,425 %, fällig 04.11.2031 *	1.407	0,77
Frankreich – 8,83 % (28. Februar 2025: 7,70 %)				GBP	1.250	London Stock Exchange Group Plc, 1,625 %, fällig 06.04.2030	1.528	0,84
EUR	1.000	Air Liquide Finance SA, 2,625 %, fällig 05.11.2029	1.180		900	Nationwide Building Society, 6,125 %, fällig 21.08.2028	1.268	0,70
EUR	800	APRR SA, 1,500 %, fällig 25.01.2030	903	GBP	500	NatWest Markets Plc, 6,375 %, fällig 08.11.2027	698	0,38
EUR	800	APRR SA, 3,125 %, fällig 20.01.2032	948	GBP	1.640	Northern Powergrid Yorkshire Plc, 5,625 %, fällig 14.11.2033	2.336	1,28
EUR	700	Banque Federative du Credit Mutuel SA, 3,375 %, fällig 10.06.2032	836		2.200	Segro Capital Sarl, 0,500 %, fällig 22.09.2031	2.273	1,25
EUR	600	BNP Paribas SA, 1,375 %, fällig 28.05.2029	677	EUR	550	Unilever Finance Netherlands BV, 1,125 %, fällig 12.02.2027	643	0,35
EUR	2.470	BNP Paribas SA, 144A, 5,176 %, fällig 09.01.2030 *	2.542		1.500	Unilever Finance Netherlands BV, 3,250 %, fällig 15.02.2032	1.803	0,99
EUR	2.600	Credit Agricole SA, 3,125 %, fällig 26.02.2032	3.087				18.981	10,42
EUR	340	Credit Agricole SA, 5,862 %, fällig 09.01.2036 *	361	USA – 47,02 % (28. Februar 2025: 47,77 %)				
EUR	300	Credit Agricole SA/London, 1,750 %, fällig 05.03.2029	344	EUR	2.000	Abbott Ireland Financing DAC, 0,375 %, fällig 19.11.2027	2.287	1,26
EUR	1.400	L'Oreal SA, 2,750 %, fällig 19.11.2030	1.664		950	Abbott Laboratories, 4,000 %, fällig 15.03.2031	949	0,52
EUR	1.100	TotalEnergies Capital International SA, 1,023 %, fällig 04.03.2027	1.284		950	Abbott Laboratories, 4,300 %, fällig 15.03.2033	949	0,52
GBP	1.700	Vinci SA, 2,250 %, fällig 15.03.2027	2.258		700	AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	719	0,39
			16.084		1.800	AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	1.869	1,03
			8,83	GBP	360	Alphabet Inc, 4,625 %, fällig 13.11.2032	490	0,27
Deutschland – 2,54 % (28. Februar 2025: 0,80 %)					280	Alphabet Inc, 4,400 %, fällig 15.02.2033	283	0,15
EUR	1.900	adidas AG, 2,750 %, fällig 06.11.2030	2.235	EUR	880	Alphabet Inc, 3,000 %, fällig 06.05.2033	1.034	0,57
EUR	1.500	HOWOGE Wohnungsbaugesellschaft mbH, 0,625 %, fällig 01.11.2028	1.680		1.400	Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	1.270	0,70
EUR	600	Siemens Finanzierungsmaatschappij NV, 2,625 %, fällig 27.05.2029	713		910	Amazon.com Inc, 4,350 %, fällig 20.03.2033	918	0,50
			4.628		470	American Express Co, 5,085 %, fällig 30.01.2031 *	486	0,27
			2,54	EUR	590	American Express Co, 3,433 %, fällig 20.05.2032 *	706	0,39
Irland – 1,58 % (28. Februar 2025: 1,70 %)				EUR	800	Bank of America Corp, 3,648 %, fällig 31.03.2029 *	965	0,53
EUR	2.400	GAS Networks Ireland, 3,250 %, fällig 12.09.2030	2.886		1.700	Caterpillar Inc, 2,600 %, fällig 09.04.2030	1.623	0,89
Italien – 0,57 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					2.900	Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	2.711	1,49
EUR	880	UniCredit SpA, 2,875 %, fällig 15.07.2030 *	1.043	EUR	1.600	Colgate-Palmolive Co, 3,250 %, fällig 10.11.2035	1.882	1,03
Japan – 2,30 % (28. Februar 2025: 1,05 %)					1.200	Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	1.209	0,66
EUR	870	Nomura Holdings Inc, 3,459 %, fällig 28.05.2030	1.046		1.330	Comcast Corp, 3,250 %, fällig 26.09.2032	1.573	0,86
EUR	360	NTT Finance Corp, 2,906 %, fällig 16.03.2029	428	EUR	1.800	Costco Wholesale Corp, 1,375 %, fällig 20.06.2027	1.750	0,96
EUR	500	NTT Finance Corp, 144A, 4,876 %, fällig 16.07.2030	513		2.000	Eaton Capital ULC, 3,601 %, fällig 21.05.2031	2.432	1,34
EUR	2.000	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 0,632 %, fällig 23.10.2029	2.194	EUR	2.000	Ecolab Inc, 2,125 %, fällig 01.02.2032	1.795	0,99
			4.181		900	Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	921	0,51
			2,30		2.000	Estee Lauder Cos Inc/The, 2,375 %, fällig 01.12.2029	1.891	1,04
Luxemburg – 0,76 % (28. Februar 2025: 0,75 %)					3.500	Goldman Sachs Group Inc/The, 2,600 %, fällig 07.02.2030	3.311	1,82
EUR	1.170	Prologis International Funding II SA, 3,125 %, fällig 01.06.2031	1.387	EUR	1.480	Home Depot Inc/The, 2,700 %, fällig 15.04.2030	1.414	0,78
Niederlande – 5,52 % (28. Februar 2025: 5,79 %)					1.600	Honeywell International Inc, 3,750 %, fällig 17.05.2032	1.939	1,06
GBP	700	ABN AMRO Bank NV, 5,125 %, fällig 22.02.2028	960		900	Honeywell International Inc, 5,000 %, fällig 15.02.2033	939	0,52
GBP	1.900	Coöperatieve Rabobank UA, 4,875 %, fällig 17.04.2029 *	2.597		1.800	Hyundai Capital America, 144A, 5,400 %, fällig 24.06.2031	1.887	1,04
EUR	1.240	Enxsis Holding NV, 3,000 %, fällig 25.02.2032	1.469	EUR	2.100	Illinois Tool Works Inc, 3,250 %, fällig 17.05.2028	2.524	1,39
EUR	1.140	Heineken NV, 2,990 %, fällig 14.07.2031	1.349	EUR	1.190	John Deere Capital Corp, 2,500 %, fällig 11.09.2028	1.407	0,77
EUR	580	Heineken NV, 3,276 %, fällig 29.10.2032	689		2.050	JPMorgan Chase & Co, 4,203 %, fällig 23.07.2029 *	2.059	1,13
EUR	1.300	ING Groep NV, 0,875 %, fällig 29.11.2030 *	1.423		150	JPMorgan Chase & Co, 4,898 %, fällig 22.01.2037 *	151	0,08
EUR	1.500	Vesteda Finance BV, 0,750 %, fällig 18.10.2031	1.559		240	Kimberly-Clark Corp, 1,050 %, fällig 15.09.2027	231	0,13
			10.046		910	Kimberly-Clark Corp, 3,950 %, fällig 01.11.2028	915	0,50
			5,52	EUR	1.600	Linde Plc, 3,125 %, fällig 20.11.2032	1.894	1,04
Norwegen – 2,30 % (28. Februar 2025: 2,98 %)					530	Mars Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2032	549	0,30
EUR	940	Avinor AS, 0,750 %, fällig 01.10.2030	1.020	EUR	2.000	Mastercard Inc, 1,000 %, fällig 22.02.2029	2.264	1,24
	230	DNB Bank ASA, 144A, 4,384 %, fällig 04.11.2031 *	231		2.420	Merck & Co Inc, 1,900 %, fällig 10.12.2028	2.311	1,27
EUR	540	Equinor ASA, 1,250 %, fällig 17.02.2027	632		1.800	Meta Platforms Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	1.831	1,00
EUR	620	Statkraft AS, 2,875 %, fällig 13.09.2029	739	EUR	2.540	Morgan Stanley, 0,495 %, fällig 26.10.2029 *	2.828	1,55
EUR	1.300	Statkraft AS, 3,375 %, fällig 22.03.2032	1.565	EUR	680	Nestle Finance International Ltd, 1,500 %, fällig 01.04.2030	774	0,42
			4.187		1.700	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	2.074	1,14
			2,30	EUR	1.600	NVIDIA Corp, 2,850 %, fällig 01.04.2030	1.540	0,85
Singapur – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,18 %)								
EUR	300	Temasek Financial I Ltd, 3,250 %, fällig 15.02.2027	357					
			0,20					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Credit Default Swaps – -0,14 % (28. Februar 2025: -0,13 %)		
USA – (Fortsetzung)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
GBP	1.030	0,76	Devisenterminkontrakte – -0,71 % (28. Februar 2025: -0,09 %)		
GBP	820	0,60	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	2.400	1,35	Futures – -0,30 % (28. Februar 2025: -0,12 %)		
EUR	2.600	1,52	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
EUR	1.200	0,79	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
EUR	2.000	1,05			
EUR	1.040	0,57	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
EUR	500	0,32			
EUR	800	0,52	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	1.700	0,89			
	1.630	0,80	Gesamtvermögen		
GBP	1.340	0,97			
EUR	1.250	0,69			
EUR	1.500	0,98			
	251	0,13			
	320	0,18			
	85.629	47,02			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 174.208 \$)					
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,41 % (28. Februar 2025: 2,48 %)					
	2.559	1,41			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 2.559 \$)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 176.767 \$)					
Devisenterminkontrakte – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,76 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
Futures – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,23 %)					
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)					
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte					

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1.000 % – Kauf	20. Dez. 2030	11.000	\$ -263
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -240 \$)				-263
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -240 \$)				\$ -263

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 11	Verkauf EUR 10	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf USD 60	Verkauf EUR 51	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1.153	Verkauf GBP 852	3
13. März 2026	BNY	Kauf USD 26	Verkauf GBP 20	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 42	Verkauf SEK 374	1
13. März 2026	BNY	Kauf USD 14	Verkauf SEK 122	–
13. März 2026	BNY	Kauf SEK 34.879	Verkauf USD 3.917	-50
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 45.827	Verkauf USD 62.684	-926
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 6.116	Verkauf USD 7.296	-64
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 20	Verkauf USD 23	–
13. März 2026	BNY	Kauf CHF 3.918	Verkauf USD 5.131	-26
12. Mai. 2026	Citi	Kauf USD 109.200	Verkauf EUR 92.249	-186
12. Mai. 2026	UBS	Kauf USD 23.136	Verkauf GBP 16.922	326
12. Mai. 2026	UBS	Kauf EUR 4.812	Verkauf USD 5.757	-51
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.358 \$)				\$ 330
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -156 \$)				-1.303
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.202 \$)				\$ -973

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-184	\$ -25.538	\$ -172
Euro-Bund März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-129	-19.850	-242
Long Gilt Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-8	-1.010	-14
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-59	-6.715	-52
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-65	-7.588	-78
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	8	1.674	2
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	48	5.287	20
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 416 \$)				\$ 22
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -218 \$)				-558
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 198 \$)				\$ -536

FTGF Western Asset Global Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 12,81 % (28. Februar 2025: 15,28 %)						
340 BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class A, 144A, 5,067 %, fällig 15.02.2042 *	341	0,35	14 Ginnie Mae II Pool 'MA4836', 3,000 %, fällig 20.11.2047	13	0,01	
340 BXMT 2026-FL6 Ltd, Series 2026 FL6, Class A, 144A, 5,150 %, fällig 19.08.2043 *	340	0,35	39 Ginnie Mae II Pool 'MA5019', 3,500 %, fällig 20.02.2048	37	0,04	
340 CIP Commercial Mortgage Trust 2025-SBAY, Series 2025 SBAY, Class A, 144A, 5,060 %, fällig 15.10.2037 *	342	0,35	44 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	44	0,04	
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	97	0,10	16 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	16	0,02	
200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,500 % ±	198	0,20	57 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	51	0,05	
500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	433	0,44	400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	339	0,35	
1.200 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	1.085	1,11	700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	618	0,63	
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	94	0,10	400 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	367	0,37	
500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	502	0,51	300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	282	0,29	
100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	102	0,10	200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,000 % ±	192	0,20	
400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	410	0,42	300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	297	0,30	
41 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	40	0,04	500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	502	0,51	
51 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01.05.2045	50	0,05	100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	101	0,10	
15 Fannie Mae Pool 'AS4271', 4,500 %, fällig 01.01.2045	15	0,02	200 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	204	0,21	
14 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 01.06.2047	14	0,01	92 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	4	–	
255 Fannie Mae Pool 'AX0756', 3,500 %, fällig 01.07.2044	248	0,25	340 MFI 2026-FL21 LLC, Series 2026 FL21, Class A, 144A, 5,014 %, fällig 18.02.2041 *	340	0,35	
68 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	65	0,07	Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 12.875 \$)		12.560	12,81
75 Fannie Mae Pool 'BK7700', 4,500 %, fällig 01.10.2048	76	0,08	Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 28,81 % (28. Februar 2025: 25,94 %)			
28 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	27	0,03	Belgien – 0,14 % (28. Februar 2025: 0,14 %)			
20 Fannie Mae Pool 'BN1623', 4,500 %, fällig 01.11.2048	20	0,02	149 Anheuser-Busch Cos LLC / Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 4,900 %, fällig 01.02.2046	140	0,14	
54 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	0,05	Brasilien – 0,31 % (28. Februar 2025: 0,53 %)			
58 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	48	0,05	330 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	299	0,31	
63 Fannie Mae Pool 'BT5574', 2,500 %, fällig 01.08.2051	55	0,06	Kanada – 0,69 % (28. Februar 2025: 0,62 %)			
210 Fannie Mae Pool 'BU1030', 2,000 %, fällig 01.11.2051	177	0,18	EUR 230 Bank of Montreal, 2,750 %, fällig 15.06.2027	273	0,28	
35 Fannie Mae Pool 'CA2047', 4,500 %, fällig 01.07.2048	35	0,04	GBP 300 Royal Bank of Canada, 3,625 %, fällig 14.06.2027	403	0,41	
70 Fannie Mae Pool 'CA2199', 4,500 %, fällig 01.08.2048	71	0,07		676	0,69	
35 Fannie Mae Pool 'CA2482', 4,500 %, fällig 01.10.2048	35	0,04	Dänemark – 0,99 % (28. Februar 2025: 0,89 %)			
238 Fannie Mae Pool 'CA6672', 2,000 %, fällig 01.07.2050	199	0,20	EUR 190 Carlsberg Breweries A/S, 3,500 %, fällig 28.02.2035	224	0,23	
18 Fannie Mae Pool 'FM1193', 3,500 %, fällig 01.06.2049	17	0,02	EUR 600 Danske Bank A/S, 4,750 %, fällig 21.06.2030 *	751	0,76	
108 Fannie Mae Pool 'FM1727', 5,000 %, fällig 01.09.2049	110	0,11		975	0,99	
65 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01.07.2051	58	0,06	Frankreich – 3,05 % (28. Februar 2025: 1,24 %)			
68 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	60	0,06	GBP 300 BNP Paribas SA, 1,875 %, fällig 14.12.2027	389	0,40	
65 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01.10.2051	57	0,06	EUR 500 BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 30.05.2028 *	577	0,59	
141 Fannie Mae Pool 'FS0331', 3,000 %, fällig 01.01.2052	129	0,13	EUR 500 Credit Agricole SA, 4,125 %, fällig 26.02.2036	611	0,62	
71 Fannie Mae Pool 'FS0424', 2,500 %, fällig 01.01.2052	63	0,06	EUR 800 Electricite de France SA, 4,375 %, fällig 17.06.2036	996	1,02	
70 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01.02.2052	64	0,06	EUR 200 Veolia Environnement SA, 3,639 %, fällig 14.01.2034	239	0,24	
75 Fannie Mae Pool 'FS0523', 2,500 %, fällig 01.02.2052	66	0,07	200 WEA Finance LLC / Westfield UK & Europe Finance Plc, 144A, 4,750 %, fällig 17.09.2044	177	0,18	
72 Fannie Mae Pool 'FS3836', 4,500 %, fällig 01.01.2053	71	0,07		2.989	3,05	
234 Fannie Mae Pool 'FS5059', 3,500 %, fällig 01.11.2048	225	0,23	Deutschland – 0,86 % (28. Februar 2025: 1,33 %)			
62 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 01.10.2050	52	0,05	EUR 500 Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft AG in München, 3,250 %, fällig 26.05.2049 *	596	0,61	
44 Freddie Mac Gold Pool 'C91987', 3,000 %, fällig 01.04.2038	43	0,04	EUR 100 ZF Europe Finance BV, 7,000 %, fällig 12.06.2030	127	0,13	
16 Freddie Mac Gold Pool 'G67721', 4,500 %, fällig 01.04.2049	16	0,02	EUR 100 ZF Europe Finance BV, 5,500 %, fällig 17.02.2032	118	0,12	
13 Freddie Mac Non Gold Pool '840698', 3,615 %, fällig 01.03.2047 *	13	0,01		841	0,86	
55 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	47	0,05	Israel – 0,35 % (28. Februar 2025: 0,73 %)			
139 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	123	0,13	180 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	138	0,14	
75 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01.02.2052	66	0,07	200 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands IV BV, 5,750 %, fällig 01.12.2030	208	0,21	
156 Freddie Mac Pool 'RA8694', 5,000 %, fällig 01.04.2053	158	0,16		346	0,35	
28 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	24	0,02	Italien – 0,17 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
57 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	48	0,05	EUR 140 Telecom Italia SpA/Milano, 3,625 %, fällig 30.09.2030	167	0,17	
66 Freddie Mac Pool 'SD0615', 4,500 %, fällig 01.01.2051	66	0,07	Luxemburg – 1,58 % (28. Februar 2025: 0,91 %)			
66 Freddie Mac Pool 'SD0653', 2,500 %, fällig 01.07.2051	58	0,06	EUR 620 Logicor Financing Sarl, 1,625 %, fällig 15.07.2027	723	0,74	
141 Freddie Mac Pool 'SD0809', 3,000 %, fällig 01.01.2052	128	0,13	EUR 680 P3 Group Sarl, 4,000 %, fällig 19.04.2032	825	0,84	
271 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	268	0,27		1.548	1,58	
119 Freddie Mac Pool 'SD2384', 6,500 %, fällig 01.02.2053	124	0,13	Niederlande – 0,52 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
69 Freddie Mac Pool 'SD2578', 6,000 %, fällig 01.03.2053	71	0,07	EUR 220 CTP NV, 3,625 %, fällig 13.04.2032	260	0,27	
140 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	124	0,13	EUR 110 Magnum Icc Finance BV, 3,750 %, fällig 26.11.2034	131	0,13	
528 Freddie Mac Pool 'SI2106', 2,500 %, fällig 01.05.2051	462	0,47	EUR 100 Magnum Icc Finance BV, 4,000 %, fällig 26.11.2037	118	0,12	
48 Freddie Mac Pool 'ZA6680', 4,000 %, fällig 01.04.2049	47	0,05		509	0,52	
49 Freddie Mac Pool 'ZS3204', 5,000 %, fällig 01.06.2041	50	0,05	Singapur – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
74 Freddie Mac Pool 'ZS3940', 4,500 %, fällig 01.06.2038	75	0,08	CNH 1.210 Temasek Financial I Ltd, 2,050 %, fällig 30.07.2035	173	0,18	
27 Freddie Mac Pool 'ZS4720', 4,500 %, fällig 01.05.2047	28	0,03	Spanien – 1,43 % (28. Februar 2025: 0,94 %)			
37 Ginnie Mae I Pool '783669', 3,000 %, fällig 15.09.2042	35	0,04	EUR 200 Aena SME SA, 3,500 %, fällig 22.01.2036	237	0,24	
271 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	261	0,27	EUR 400 Banco Santander SA, 5,750 %, fällig 23.08.2033 *	500	0,51	
14 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	13	0,01	EUR 100 CaixaBank SA, 3,875 %, fällig 20.01.2037 *	120	0,12	
8 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	8	0,01	EUR 500 Cellnex Finance Co SA, 2,000 %, fällig 15.09.2032	543	0,56	
33 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	31	0,03		1.400	1,43	
23 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	21	0,02	Schweiz – 0,37 % (28. Februar 2025: 0,66 %)			
19 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	18	0,02	EUR 100 UBS Group AG, 1,000 %, fällig 24.06.2027 *	118	0,12	
13 Ginnie Mae II Pool '784825', 3,500 %, fällig 20.10.2049	12	0,01	250 UBS Group AG, 144A, 4,194 %, fällig 01.04.2031 *	249	0,25	
61 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, fällig 20.12.2050	51	0,05		367	0,37	
120 Ginnie Mae II Pool '785219', 2,000 %, fällig 20.12.2050	101	0,10				
62 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, fällig 20.12.2050	53	0,05				
120 Ginnie Mae II Pool '785221', 2,000 %, fällig 20.12.2050	101	0,10				
58 Ginnie Mae II Pool 'B58546', 2,500 %, fällig 20.12.2050	50	0,05				
66 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig 20.12.2050	57	0,06				
79 Ginnie Mae II Pool 'B24350', 2,500 %, fällig 20.03.2051	68	0,07				
59 Ginnie Mae II Pool 'CD8312', 2,500 %, fällig 20.05.2051	52	0,05				
11 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	11	0,01				
11 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	11	0,01				
14 Ginnie Mae II Pool 'MA4068', 3,000 %, fällig 20.11.2046	13	0,01				
10 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	10	0,01				

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Bond Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)							
Vereinigte Arabische Emirate – 0,88 % (28. Februar 2025: 0,80 %)							
	530	Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 2,625 %, fällig 31.03.2036	472	0,48			
EUR	400	MDGH GMTN RSC Ltd, 1,000 %, fällig 10.03.2034	390	0,40			
			862	0,88			
Vereinigtes Königreich – 1,57 % (28. Februar 2025: 2,52 %)							
GBP	10	Aviva Plc, 6,125 %, fällig 14.11.2036 *	14	0,02	EUR	500	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030
GBP	100	Aviva Plc, 5,125 %, fällig 04.06.2050 *	136	0,14	EUR	380	Prologis Euro Finance LLC, 0,500 %, fällig 16.02.2032
GBP	170	Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030	233	0,24	EUR	271	Prologis Euro Finance LLC, 1,500 %, fällig 08.02.2034
EUR	300	H5BC Holdings Plc, 3,019 %, fällig 15.06.2027 *	355	0,36		80	Shell Finance US Inc, 2,750 %, fällig 06.04.2030
EUR	140	Segro Capital Sarl, 1,875 %, fällig 23.03.2030	160	0,16		90	Shell Finance US Inc, 4,375 %, fällig 11.05.2045
EUR	190	Segro Plc, 3,500 %, fällig 24.09.2032	227	0,23		60	Shell Finance US Inc, 3,250 %, fällig 06.04.2050
	460	Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	410	0,42		10	Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032
			1.535	1,57		4	Teachers Insurance & Annuity Association of America, 6,850 %, fällig 16.12.2039
USA – 15,72 % (28. Februar 2025: 14,61 %)							
	120	AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	111	0,11		60	Texas Instruments Inc, 1,750 %, fällig 04.05.2030
	240	AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	202	0,21		100	Time Warner Cable LLC, 7,300 %, fällig 01.07.2038
GBP	190	Alphabet Inc, 4,625 %, fällig 13.11.2032	258	0,26		10	Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039
	10	Alphabet Inc, 4,375 %, fällig 15.11.2032	10	0,01		90	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029
EUR	100	Alphabet Inc, 3,000 %, fällig 06.05.2033	117	0,12		160	T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030
EUR	100	Alphabet Inc, 3,125 %, fällig 06.11.2034	117	0,12		20	T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031
	60	Alphabet Inc, 4,700 %, fällig 15.11.2035	61	0,06	EUR	100	T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031
EUR	100	Alphabet Inc, 3,375 %, fällig 06.05.2037	116	0,12		150	T-Mobile USA Inc, 2,700 %, fällig 15.03.2032
	180	Amazon.com Inc, 4,650 %, fällig 20.11.2035	181	0,18		100	T-Mobile USA Inc, 3,700 %, fällig 08.05.2032
	150	Amazon.com Inc, 5,450 %, fällig 20.11.2055	148	0,15		140	T-Mobile USA Inc, 3,000 %, fällig 15.02.2041
	40	American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	37	0,04		220	United Rentals North America Inc, 3,875 %, fällig 15.02.2031
	50	AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	45	0,05		50	United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034
	174	AT&T Inc, 4,500 %, fällig 09.03.2048	146	0,15		50	Verizon Communications Inc, 2,355 %, fällig 15.03.2032
	20	AT&T Inc, 3,650 %, fällig 15.09.2059	13	0,01		160	Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033
	30	Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	30	0,03		50	Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037
	835	Bank of America Corp, 2,592 %, fällig 29.04.2031 *	785	0,80		10	Verizon Communications Inc, 4,862 %, fällig 21.08.2046
	360	Bank of America Corp, 5,015 %, fällig 22.07.2033 *	371	0,38		10	Verizon Communications Inc, 5,500 %, fällig 16.03.2047
	110	BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	109	0,11		160	VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028
	130	Broadcom Inc, 144A, 3,137 %, fällig 15.11.2035	114	0,12		410	Wells Fargo & Co, 4,897 %, fällig 25.07.2033 *
EUR	150	Carnival Plc, 4,125 %, fällig 15.07.2031	183	0,19		770	Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *
	60	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	60	0,06			15.411
	160	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,050 %, fällig 30.03.2029	162	0,17			15,72
	110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	96	0,10		Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 28.713 \$)	
	110	Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,250 %, fällig 01.04.2053	89	0,09		28.238	28,81
	110	Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	103	0,10		Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 50,22 % (28. Februar 2025: 49,42 %)	
	270	Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	273	0,28		Belgien – 0,40 % (28. Februar 2025: 0,37 %)	
	230	Cigna Group/The, 3,200 %, fällig 15.03.2040	184	0,19	EUR	330	Königreich Belgien, Staatsanleihe, Serie 71, 3,750 %, fällig 22.06.2045
	80	Cigna Group/The, 4,900 %, fällig 15.12.2048	72	0,07		388	0,40
	50	Citigroup Inc, 4,600 %, fällig 09.03.2026	50	0,05		Brasilien – 2,38 % (28. Februar 2025: 1,89 %)	
	300	Citigroup Inc, 4,300 %, fällig 20.11.2026	300	0,31	BRL	13.337	Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031
	260	Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	262	0,27		2.329	2,38
EUR	100	Citigroup Inc, 4,296 %, fällig 23.07.2036 *	120	0,12		Kanada – 2,18 % (28. Februar 2025: 1,72 %)	
	93	Citigroup Inc, 5,300 %, fällig 06.05.2044	90	0,09	CAD	920	Kanada, Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.09.2030
	50	Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 30.07.2045	46	0,05	CAD	740	Kanadische Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.06.2033
	66	Comcast Corp, 3,999 %, fällig 01.11.2049	50	0,05	CAD	310	Kanada, Staatsanleihe, 3,250 %, fällig 01.12.2035
	250	Comcast Corp, 2,887 %, fällig 01.11.2051	151	0,15	CAD	170	Kanada, Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.12.2055
	51	Comcast Corp, 4,049 %, fällig 01.11.2052	38	0,04	CAD	900	Province of Ontario Canada, 3,450 %, fällig 02.06.2045
	27	Comcast Corp, 2,987 %, fällig 01.11.2063	15	0,02		585	0,60
	360	CSC Holdings LLC, 144A, 4,500 %, fällig 15.11.2031	216	0,22		2.132	2,18
	90	CVS Health Corp, 3,750 %, fällig 01.04.2030	89	0,09		Frankreich – 2,05 % (28. Februar 2025: 1,91 %)	
	280	CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	250	0,26	EUR	1.510	Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 0,000 %, fällig 25.05.2032
	40	Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	39	0,04	EUR	450	Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 1,500 %, fällig 25.05.2050
	310	Enterprise Products Operating LLC, 5,100 %, fällig 15.02.2045	297	0,30	EUR	160	Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 4,000 %, fällig 25.04.2060
	10	Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	11	0,01		182	0,18
	180	Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	180	0,18		2.014	2,05
	70	Ford Motor Co, 3,250 %, fällig 12.02.2032	63	0,06		Deutschland – 3,51 % (28. Februar 2025: 7,40 %)	
	20	Freeport-McMoRan Inc, 5,450 %, fällig 15.03.2043	20	0,02	EUR	800	Bundesobligation, Serie 191, 2,400 %, fällig 18.04.2030
	10	General Motors Co, 5,200 %, fällig 01.04.2045	9	0,01	EUR	890	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028
	70	General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	76	0,08	EUR	790	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031
	520	Goldman Sachs Group Inc/The, 6,750 %, fällig 01.10.2037	584	0,60	EUR	110	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Serie TWIN, 0,000 %, fällig 15.08.2031
	130	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,387 %, fällig 02.02.2041 *	129	0,13	EUR	390	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Serie 2007, 4,250 %, fällig 04.07.2039
	100	Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	94	0,10		529	0,54
	260	Haleon US Capital LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	251	0,26		3.444	3,51
	280	HCA Inc, 5,250 %, fällig 15.06.2026	280	0,29		Indonesien – 0,24 % (28. Februar 2025: 1,24 %)	
	70	HCA Inc, 4,500 %, fällig 15.02.2027	70	0,07	IDR	3.462.000	Indonesien, Schatzanleihe, Serie FR79, 8,375 %, fällig 15.04.2039
	880	JPMorgan Chase & Co, 2,522 %, fällig 22.04.2031 *	826	0,84		238	0,24
	440	JPMorgan Chase & Co, 2,956 %, fällig 13.05.2031 *	419	0,43		Italien – 1,71 % (28. Februar 2025: 1,50 %)	
	20	JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, fällig 14.09.2033 *	21	0,02	EUR	1.570	Italien, Buoni Poliennali Del Tesoro, Serie 31Y, 144A, 3 250 %, fällig 01.09.2046
	30	McDonald's Corp, 3,625 %, fällig 01.09.2049	23	0,02		1.679	1,71

FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)									
Japan – 10,26 % (28. Februar 2025: 10,47 %)									
JPY	278.800	Japan, 5-jährige Staatsanleihe, Serie 169, 0,500 %, fällig 20.03.2029	1.740	1,78	230	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.04.2030	233	0,24	
JPY	273.450	Japan, 5-jährige Staatsanleihe, Serie 170, 0,600 %, fällig 20.06.2029	1.707	1,74	320	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	325	0,33	
JPY	293.500	Japan, 10-jährige Staatsanleihe, Serie 375, 1,100 %, fällig 20.06.2034	1.759	1,79	2.920	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.01.2031	2.950	3,01	
JPY	14.850	Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 59, 0,700 %, fällig 20.06.2048	58	0,06	20	United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 15.11.2047	15	0,01	
JPY	335.850	Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 66, 0,400 %, fällig 20.03.2050	1.141	1,16	300	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055 ≠	306	0,31	
JPY	186.900	Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 67, 0,600 %, fällig 20.06.2050	669	0,68			6.768	6,90	
JPY	168.600	Japan, 20-jährige Staatsanleihe, Serie 149, 1,500 %, fällig 20.06.2034	1.043	1,07	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 51.985 \$)			49.227	50,22
JPY	302.950	Japan, 2-jährige Staatsanleihe, Serie 462, 0,400 %, fällig 01.07.2026	1.938	1,98	Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,53 % (28. Februar 2025: 9,18 %)				
			10.055	10,26	451	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	7.377	7,53	
Kuwait – 0,76 % (28. Februar 2025: 0,00 %)									
	740	Kuwait, Internationale Staatsanleihe, 4,136 %, fällig 09.10.2030	744	0,76	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 6.466 \$)			7.377	7,53
Mexiko – 2,47 % (28. Februar 2025: 2,44 %)									
MXN	31.710	Mexiko, Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	1.626	1,66	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 100.039 \$)			97.402	99,37
	750	Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 6,625 %, fällig 29.01.2038	794	0,81	Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
			2.420	2,47	Gekaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				
Niederlande – 0,99 % (28. Februar 2025: 0,85 %)									
EUR	970	BNG Bank NV, 0,010 %, fällig 05.10.2032	967	0,99	2.930	USD Call/CAD Put 1.50, fällig 10.02.2027 – JP Morgan	5	–	
Norwegen – 1,95 % (28. Februar 2025: 1,67 %)									
NOK	2.420	Norwegen, Staatsanleihe, Serie 484, 144A, 2,125 %, fällig 18.05.2032	229	0,24	Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 6 \$)			5	–
NOK	11.880	Norwegen, Staatsanleihe, Serie 486, 144A, 3,000 %, fällig 15.08.2033	1.167	1,19	Devisenterminkontrakte – 0,22 % (28. Februar 2025: 0,28 %)				
NOK	5.010	Norwegen, Staatsanleihe, Serie 487, 144A, 3,625 %, fällig 13.04.2034	511	0,52	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			214	0,22
			1.907	1,95	Futures – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,45 %)				
Polen – 1,16 % (28. Februar 2025: 1,67 %)									
PLN	4.730	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.137	1,16	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)			177	0,18
Rumänien – 0,12 % (28. Februar 2025: 0,00 %)									
EUR	70	Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 6,250 %, fällig 10.09.2034	90	0,09	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			97.798	99,77
	30	Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 6,625 %, fällig 16.05.2036	32	0,03	Kontrakte (in Tsd.)			Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
			122	0,12	Verkaufte Optionen – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				
Südafrika – 2,36 % (28. Februar 2025: 1,81 %)									
ZAR	25.030	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2030, 8,000 %, fällig 31.01.2030	1.618	1,65	-950	USD Put/CAD Call 1.3460, fällig 09.05.2026 – JP Morgan	-5	–	
ZAR	13.292	Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	698	0,71	Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -7 \$)			-5	–
			2.316	2,36	Devisenterminkontrakte – -0,97 % (28. Februar 2025: -0,98 %)				
Südkorea – 4,24 % (28. Februar 2025: 1,76 %)									
KRW	2.533.840	Korea, Schatzanleihe, Serie 2606, 1,875 %, fällig 10.06.2026	1.758	1,79	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-949	-0,97
KRW	3.700.000	Koreanische Staatsanleihe, Serie 3506, 2,625 %, fällig 10.06.2035	2.398	2,45	Futures – -0,12 % (28. Februar 2025: -0,27 %)				
			4.156	4,24	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)			-114	-0,12
Spanien – 0,61 % (28. Februar 2025: 0,66 %)									
EUR	190	Spanische Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2044	272	0,28	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			-1.068	-1,09
EUR	330	Spanien, Staatsanleihe, Serie 30Y, 144A, 2,700 %, fällig 31.10.2048	329	0,33	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			96.730	98,68
			601	0,61	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte			1294	1,32
Vereinigtes Königreich – 5,93 % (28. Februar 2025: 5,04 %)									
GBP	330	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,375 %, fällig 07.03.2030	456	0,47	Gesamtnettvermögen			98.024 \$	100,00
GBP	2.340	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 07.06.2032	3.225	3,29	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.				
GBP	1.350	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,250 %, fällig 07.12.2040	1.734	1,77	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 8.979.000 \$ und machten 9,16 % des Nettovermögens aus.			
GBP	510	United Kingdom Gilt, 2,500 %, fällig 22.07.2065	395	0,40	*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.			
			5.810	5,93	≠	Das Wertpapier (in seiner Gesamtheit oder in Teilen) ist zum 28. Februar 2026 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.			
USA – 6,90 % (28. Februar 2025: 4,14 %)									
	1.060	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.01.2036 β	1.074	1,09	±	Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.			
	190	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.06.2027	193	0,20	β	Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.			
	730	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2027	732	0,75					
	910	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 31.05.2029	940	0,96					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	85,43
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,00
Finanzderivate	0,38
Sonstige Vermögenswerte	7,19
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
12. März 2026	Citi	Kauf USD 494	Verkauf BRL 2.620	\$ -15
12. März 2026	Citi	Kauf USD 7.160	Verkauf CNH 50.310	-180
12. März 2026	Citi	Kauf BRL 1.850	Verkauf USD 326	33
12. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 2.137	Verkauf BRL 11.560	-111
12. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 244	Verkauf IDR 4.078.140	1
12. März 2026	Goldman Sachs	Kauf BRL 420	Verkauf USD 78	4
12. März 2026	JP Morgan	Kauf USD 4.225	Verkauf KRW 6.191.455	-79
13. März 2026	BNY	Kauf CAD 105.865	Verkauf USD 78.102	-451
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 214	Verkauf USD 255	-2
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 2	Verkauf USD 3	–
12. Mai 2026	BNP Paribas	Kauf USD 412	Verkauf CAD 554	4
12. Mai 2026	Citi	Kauf USD 1.682	Verkauf CAD 2.287	–
12. Mai 2026	Citi	Kauf USD 24.010	Verkauf EUR 20.283	-41
12. Mai 2026	Citi	Kauf JPY 30.980	Verkauf USD 201	-1
12. Mai 2026	HSBC	Kauf USD 1.659	Verkauf CNH 11.440	-16
12. Mai 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 288	Verkauf PLN 1.029	–
12. Mai 2026	Morgan Stanley	Kauf NOK 3.538	Verkauf USD 366	6
12. Mai 2026	Morgan Stanley	Kauf AUD 953	Verkauf USD 663	15
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 95	Verkauf EUR 80	–
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 7.557	Verkauf GBP 5.527	107
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 9.838	Verkauf JPY 1.520.952	36
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 1.481	Verkauf MXN 25.782	-6
12. Mai 2026	UBS	Kauf SEK 8.581	Verkauf NOK 9.260	-19
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 986	Verkauf SEK 8.792	8
12. Mai 2026	UBS	Kauf EUR 2.312	Verkauf USD 2.757	-16
12. Mai 2026	UBS	Kauf USD 2.259	Verkauf ZAR 36.362	-12
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 276 \$)				\$ 214
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -954 \$)				-949
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -678 \$)				\$ -735

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
10 Year Mini Japanese Government Bond März 2026	Bank of America Merrill Lynch	17	\$ 1.446	\$ -7
Australia 10 Year Bond März 2026	Bank of America Merrill Lynch	42	3.305	44
Euro-Bobl März 2026	Bank of America Merrill Lynch	2	278	2
Euro-BTP März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-3	-435	-7
Euro-Bund März 2026	Bank of America Merrill Lynch	5	770	16
Euro-Buxl 30 Year Bond März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-1	-135	-4
Euro-OAT März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-6	-879	-19
Euro-Schatz März 2026	Bank of America Merrill Lynch	51	6.450	7
Japan 10 Year Bond (OSE) März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-6	-5.102	16
Long Gilt Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-5	-631	-9
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	41	4.666	31
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-57	-6.654	-68
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	63	13.184	21
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	38	4.185	17
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	13	1.540	15
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	5	608	8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 434 \$)				\$ 177
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -263 \$)				-114
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 171 \$)				\$ 63

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 85,40 % (28. Februar 2025: 87,99 %)				USA – 34,18 % (28. Februar 2025: 38,02 %)			
Australien – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,73 %)							
	50 Glencore Finance Canada Ltd, 6,000 %, fällig 15.11.2041	53	0,51		20 Abbott Laboratories, 4,650 %, fällig 15.03.2036	20	0,19
Belgien – 2,32 % (28. Februar 2025: 1,84 %)					20 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 15.03.2038	20	0,19
EUR	100 FLUVIUS System Operator CV, 3,875 %, fällig 09.05.2033	122	1,17		20 Abbott Laboratories, 5,500 %, fällig 15.03.2056	20	0,19
EUR	100 Shurgard Luxembourg Sarl, 4,000 %, fällig 27.05.2035	120	1,15		100 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	98	0,94
		242	2,32		30 AbbVie Inc, 4,875 %, fällig 14.11.2048	28	0,27
Kanada – 0,21 % (28. Februar 2025: 0,74 %)					100 Air Lease Corp, 3,125 %, fällig 01.12.2030	94	0,90
	20 Vale Canada Ltd, 7,200 %, fällig 15.09.2032	22	0,21		10 Alphabet Inc, 4,400 %, fällig 15.02.2033	10	0,10
Dänemark – 1,14 % (28. Februar 2025: 2,57 %)					20 Alphabet Inc, 5,650 %, fällig 15.02.2056	21	0,20
EUR	100 Carlsberg Breweries A/S, 3,250 %, fällig 28.02.2032	119	1,14		30 Amazon.com Inc, 4,650 %, fällig 20.11.2035	30	0,29
Frankreich – 7,96 % (28. Februar 2025: 8,71 %)					20 Amazon.com Inc, 5,450 %, fällig 20.11.2055	20	0,19
EUR	100 BNP Paribas SA, 3,739 %, fällig 20.04.2034 *	120	1,15		70 American Airlines Inc/AA Advantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029	71	0,68
EUR	100 Credit Agricole SA, 5,875 %, Ewige Anleihe *	123	1,18		10 Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	10	0,10
	100 Electricite de France SA, 144A, 5,750 %, fällig 13.01.2035	107	1,02		60 Apple Inc, 2,650 %, fällig 11.05.2050	38	0,37
EUR	100 Engie SA, 3,875 %, fällig 06.03.2036	121	1,16		100 AT&T Inc, 3,600 %, fällig am 01.06.2033	120	1,15
EUR	100 GELF Bond Issuer I SA, 3,625 %, fällig 27.11.2031	120	1,15		150 Bank of America Corp, 5,744 %, fällig 12.02.2036 *	157	1,50
EUR	100 Thales SA, 4,125 %, fällig 18.10.2028	122	1,17		30 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,200 %, fällig 15.08.2048	25	0,24
EUR	100 Veolia Environnement SA, 3,795 %, fällig 17.06.2037	118	1,13		20 Broadcom Inc, 4,300 %, fällig 15.11.2032	20	0,19
		831	7,96		20 Broadcom Inc, 4,900 %, fällig 15.02.2038	20	0,19
Deutschland – 6,29 % (28. Februar 2025: 5,59 %)					50 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	52	0,50
	30 Deutsche Telekom International Finance BV, 8,750 %, fällig 15.06.2030	35	0,34		30 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	29	0,28
EUR	100 Hannover Rück SE, 1,125 %, fällig 09.10.2039 *	110	1,05	EUR	120 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	87	0,83
	150 RWE Finance US LLC, 144A, 5,125 %, fällig 18.09.2035	150	1,44		10 Chevron USA Inc, 3,850 %, fällig 15.01.2028	10	0,10
EUR	100 Sirius Real Estate Ltd, 4,000 %, fällig 22.01.2032	120	1,15		30 Cigna Group/The, 2,400 %, fällig 15.03.2030	28	0,27
EUR	100 TAG Immobilien AG, 4,250 %, fällig 04.03.2030	123	1,18		30 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	39	0,37
EUR	100 ZF Europe Finance BV, 5,500 %, fällig 17.02.2032	118	1,13		40 Citigroup Inc, 6,625 %, Ewige Anleihe*	41	0,40
		656	6,29		10 Coca-Cola Co/The, 5,200 %, fällig 14.01.2055	10	0,09
Irland – 2,32 % (28. Februar 2025: 0,71 %)					50 Comcast Corp, 3,150 %, fällig 15.02.2028	49	0,47
	150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,850 %, fällig 29.10.2041	125	1,20		60 Comcast Corp, 4,950 %, fällig 15.10.2058	52	0,49
EUR	100 Flutter Treasury DAC, 4,000 %, fällig 04.06.2031	117	1,12		30 Continental Resources Inc/OK, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2031	31	0,30
		242	2,32	EUR	110 CRH SMW Finance DAC, 4,000 %, fällig 11.07.2031	136	1,31
Italien – 2,69 % (28. Februar 2025: 2,50 %)					10 CVS Health Corp, 5,050 %, fällig 25.03.2048	9	0,08
	150 Enel Finance International NV, 144A, 6,000 %, fällig 07.10.2039	160	1,53		30 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	27	0,26
EUR	100 Esercizi Aeroportuali SEA SpA, 3,500 %, fällig 22.01.2032	120	1,16		30 Diamondback Energy Inc, 5,750 %, fällig 18.04.2054	29	0,28
		280	2,69		50 Energy Transfer LP, 5,200 %, fällig 01.04.2030	52	0,50
Luxemburg – 1,14 % (28. Februar 2025: 2,06 %)					50 Energy Transfer LP, 5,600 %, fällig 01.09.2034	52	0,50
EUR	100 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 3,500 %, fällig 29.01.2031	119	1,14		60 Enterprise Products Operating LLC, 4,250 %, fällig 15.02.2048	50	0,48
Niederlande – 6,91 % (28. Februar 2025: 3,63 %)					30 Fedex Freight Holding Co Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.03.2036	30	0,29
EUR	100 Amvest RCF Custodian BV, 3,750 %, fällig 11.06.2031	121	1,16		10 FirstEnergy Transmission LLC, 5,000 %, fällig 15.01.2035	10	0,10
EUR	100 Cooperatieve Rabobank UA, 3,822 %, fällig 26.07.2034	122	1,16		10 Florida Gas Transmission Co LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.07.2035	11	0,10
EUR	100 CTP NV, 3,625 %, fällig 13.04.2032	118	1,13		20 Florida Power & Light Co, 5,300 %, fällig 15.06.2034	21	0,20
EUR	100 REWE International Finance BV, 3,500 %, fällig 03.07.2032	120	1,15		30 GE Vernova Inc, 4,875 %, fällig 04.02.2036	30	0,29
EUR	100 Vesteda Finance BV, 4,000 %, fällig 07.05.2032	123	1,18		10 General Motors Co, 6,750 %, fällig 01.04.2046	11	0,10
EUR	100 VIA Outlets BV, 3,500 %, fällig 29.10.2032	117	1,13		70 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,016 %, fällig 23.10.2035 *	71	0,68
		721	6,91		70 Goldman Sachs Group Inc/The, 3,984 %, fällig 18.12.2036 *	84	0,80
Neuseeland – 1,14 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					30 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,150 %, fällig 22.05.2045	28	0,27
EUR	100 Chorus Ltd, 3,529 %, fällig 26.11.2032	119	1,14		10 Gulfstream Natural Gas System LLC, 144A, 5,600 %, fällig 23.07.2035	10	0,10
Südafrika – 2,01 % (28. Februar 2025: 0,60 %)					60 HCA Inc, 3,500 %, fällig 01.09.2030	58	0,56
	200 Anglo American Capital Plc, 144A, 5,500 %, fällig 02.05.2033	210	2,01		30 HEICO Corp, 5,250 %, fällig 01.08.2028	31	0,30
Spanien – 3,63 % (28. Februar 2025: 3,47 %)					100 JPMorgan Chase & Co, 1,812 %, fällig 12.06.2029 *	116	1,11
EUR	100 Aena SME SA, 3,500 %, fällig 22.01.2036	118	1,14		80 JPMorgan Chase & Co, 4,810 %, fällig 22.10.2036 *	80	0,77
GBP	100 CaixaBank SA, 6,875 %, fällig 25.10.2033 *	142	1,36		10 JPMorgan Chase & Co, 4,898 %, fällig 22.01.2037 *	10	0,10
EUR	100 Iberdrola Finanzas SA, 3,375 %, fällig 30.09.2035	118	1,13		70 Mars Inc, 144A, 5,200 %, fällig 01.03.2035	73	0,69
		378	3,63		30 Marsh & McLennan Cos Inc, 4,850 %, fällig 15.11.2031	31	0,30
Schweiz – 2,06 % (28. Februar 2025: 1,86 %)					60 McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	59	0,57
	200 UBS Group AG, 7,750 %, Ewige Anleihe *	215	2,06		30 Meta Platforms Inc, 4,875 %, fällig 15.11.2035	30	0,29
Vereinigtes Königreich – 10,89 % (28. Februar 2025: 10,47 %)					30 Meta Platforms Inc, 5,625 %, fällig 15.11.2055	29	0,28
GBP	100 Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030	137	1,31		30 Microsoft Corp, 2,921 %, fällig 17.03.2052	20	0,19
	200 Lloyds Banking Group Plc, 5,721 %, fällig 05.06.2030 *	210	2,02		100 Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029 *	123	1,18
EUR	110 Manchester Airport Group Funding Plc, 4,000 %, fällig 19.03.2035	133	1,28		50 Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	53	0,50
GBP	50 Marston's Issuer Plc, Series B1, 6,413 %, fällig 16.07.2035 *	64	0,61		30 NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	31	0,29
	200 NatWest Group Plc, 4,892 %, fällig 18.05.2029 *	204	1,95		30 Occidental Petroleum Corp, 5,375 %, fällig 01.01.2032	31	0,30
EUR	100 Sage Group Plc/The, 3,821 %, fällig 25.02.2033	118	1,13		80 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 01.04.2035	84	0,80
EUR	100 SSE Plc, 4,000 %, Ewige Anleihe *	119	1,15		10 Oracle Corp, 5,350 %, fällig 04.05.2033	10	0,10
EUR	120 Tesco Corporate Treasury Services Plc, 4,250 %, fällig 27.02.2031	150	1,44		10 Oracle Corp, 5,700 %, fällig 04.02.2036	10	0,10
		1.135	10,89		10 Oracle Corp, 5,875 %, fällig 26.09.2045	9	0,09
					10 Pacific Gas and Electric Co, 5,700 %, fällig 01.03.2035	10	0,10
					30 Prudential Financial Inc, 3,000 %, fällig 10.03.2040	23	0,22
					20 Royal Caribbean Cruises Ltd, 3,700 %, fällig 15.03.2028	20	0,19
					10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,750 %, fällig 15.05.2033	10	0,10
					10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,375 %, fällig 15.01.2036	10	0,10
					10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 27.02.2038	10	0,10
					50 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	50	0,48
					10 Stryker Corp, 4,700 %, fällig 10.02.2028	10	0,10
					10 Synopsys Inc, 5,150 %, fällig 01.04.2035	10	0,10
					40 Targa Resources Corp, 4,950 %, fällig 15.04.2052	35	0,33

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten – \$)		
USA – (Fortsetzung)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 9.754 \$)		
60 Texas Instruments Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2039	54	0,52	Devisenterminkontrakte – 0,45 % (28. Februar 2025: 0,15 %)	9.975	95,65
50 T-Mobile USA Inc, 5,125 %, fällig 15.05.2032	52	0,50	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	47	0,45
50 T-Mobile USA Inc, 5,650 %, fällig 15.01.2053	49	0,47	Futures – 0,12 % (28. Februar 2025: 0,39 %)		
10 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	11	0,10	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	12	0,12
50 Verizon Communications Inc, 5,250 %, fällig 16.03.2037	51	0,49	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	10.034	96,22
10 Vertiv Holdings Co, 4,850 %, fällig 15.03.2036	10	0,09	Credit Default Swaps – -0,48 % (28. Februar 2025: -0,44 %)		
10 Vertiv Holdings Co, 5,800 %, fällig 15.03.2056	10	0,10	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-50	-0,48
30 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 4,125 %, fällig 15.08.2030	29	0,28	Devisenterminkontrakte – -0,79 % (28. Februar 2025: -0,08 %)		
30 Vistra Operations Co LLC, 144A, 4,700 %, fällig 31.01.2031	30	0,29	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-83	-0,79
10 Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2032	11	0,10	Futures – -0,24 % (28. Februar 2025: -0,05 %)		
70 Wells Fargo & Co, 5,389 %, fällig 24.04.2034 *	73	0,70	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-25	-0,24
110 Wells Fargo & Co, 5,013 %, fällig 04.04.2051 *	101	0,96	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-158	-1,51
40 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	35	0,33	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	9.876	94,71
40 Williams Cos Inc/The, 5,300 %, fällig 15.08.2028	41	0,40	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	553	5,29
20 Williams Cos Inc/The, 5,750 %, fällig 24.06.2044	20	0,19	Gesamt Nettovermögen	10.429 \$	100,00
	3.564	34,18	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.690 \$)	8.906	85,40	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.072.000 \$ und machten 10,24 % des Nettovermögens aus.		
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen: 9,47 % (28. Februar 2025: 6,37 %)			* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
Deutschland – 4,05 % (28. Februar 2025: 2,71 %)			† Nicht liquide.		
EUR 200 Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Serie TWIN, 0,000 %, fällig 15.08.2031	209	2,01	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
EUR 90 Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, Serie 05, 4,000 %, fällig 04.01.2037	119	1,14	ABKÜRZUNGEN:		
EUR 190 Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.08.2052	95	0,90	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
	423	4,05	EUR – Euro		
Japan – 0,33 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			GBP – Britisches Pfund Sterling		
JPY 5.300 Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 89, 3,400 %, fällig 20.12.2055	34	0,33	JPY – Japanischer Yen		
Mexiko – 1,94 % (28. Februar 2025: 0,67 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
200 Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 5,625 %, fällig 09.02.2034	202	1,94	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,68	
Rumänien – 0,37 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Organismen für gemeinsame Anlagen	0,75	
EUR 30 Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 6,250 %, fällig 10.09.2034	39	0,37	Finanzderivate	0,55	
USA – 2,78 % (28. Februar 2025: 1,62 %)			Sonstige Vermögenswerte	7,02	
20 United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.01.2031	20	0,19	Gesamtvermögen	100,00	
260 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	270	2,59			
	290	2,78			
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 983 \$)	988	9,47			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,78 % (28. Februar 2025: 5,13 %)					
81 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	81	0,78			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 81 \$)	81	0,78			
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
680 Credit Suisse Group AG Escrow t=∞	–	–			

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2030	440	\$ -9
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2030	430	-10
Bank of America Merrill Lynch	iTraxx Europe, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2030	260	-31
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -119 \$)				-50
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -119 \$)				\$ -50

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 6.167	Verkauf	EUR 5.198	\$ 21	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 5.231	Verkauf	USD 6.240	-56	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 4	Verkauf	USD 5	–	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	USD 5	Verkauf	CAD 7	–	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	GBP 41	Verkauf	EUR 47	–	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	USD 7.888	Verkauf	EUR 6.663	-13	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	EUR 286	Verkauf	GBP 248	5	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	GBP 95	Verkauf	USD 130	-2	
12. Mai. 2026	Citi	Kauf	EUR 100	Verkauf	USD 119	-1	
12. Mai. 2026	Deutsche Bank	Kauf	EUR 370	Verkauf	USD 437	2	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	GBP 126	Verkauf	EUR 144	-1	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	USD 65	Verkauf	EUR 55	–	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	USD 1.277	Verkauf	GBP 934	18	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	USD 71	Verkauf	JPY 10.837	1	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	EUR 2.014	Verkauf	USD 2.393	-5	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	GBP 536	Verkauf	USD 728	-5	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	GBP 32	Verkauf	USD 43	–	
12. Mai. 2026	UBS	Kauf	JPY 4.000	Verkauf	USD 26	–	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 41 \$)						\$ 47	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -21 \$)						-83	
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 20 \$)						\$ -36	

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Euro-Bobl März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-8	\$ -1.110	\$ -6
Euro-Bund März 2026	Bank of America Merrill Lynch	-6	-923	-13
Euro-Schatz März 2026	Bank of America Merrill Lynch	5	632	1
Long Gilt Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	1	126	2
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-5	-584	-6
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	5	1.047	1
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	6	661	3
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	2	237	2
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	2	243	3
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 107 \$)				\$ 12
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -14 \$)				-25
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 93 \$)				\$ -13

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 9,32 % (28. Februar 2025: 12,30 %)					
53 ABFC 2003-OPT1 Trust, Series 2003 OPT1, Class A3, 4,468 %, fällig 25.04.2033 *	53	0,02	940 Option One Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class M4, 4,718 %, fällig 25.08.2035 *	841	0,25
550 Abry Liquid Credit CLO 2025-2 Ltd, Series 2025 2A, Class D, 144A, 6,835 %, fällig 15.01.2039 *	556	0,17	820 Palmer Square CLO 2022-3 Ltd, Series 2022 3A, Class D1R, 144A, 6,618 %, fällig 20.07.2037 *	824	0,24
425 Aegis Asset Backed Securities Trust Mortgage Pass-Through Ctfs Ser 2005-4, Series 2005 4, Class M2, 4,493 %, fällig 25.10.2035 *	414	0,12	460 Peace Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class ER, 144A, 8,568 %, fällig 20.10.2038 *	436	0,13
230 AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 6,568 %, fällig 17.07.2037 *	232	0,07	860 Phantom Aviation, Series 2026 1A, Class B, 144A, 6,027 %, fällig 15.01.2051	871	0,26
560 Antares CLO 2021-1 Ltd, Series 2021 1A, Class DR, 144A, 6,868 %, fällig 25.10.2038 *	560	0,17	270 Pikes Peak CLO 6, Series 2020 6A, Class ERR, 144A, 8,255 %, fällig 18.05.2034 *	270	0,08
600 Apidos CLO XXX XXXA, Class CR, 144A, 6,668 %, fällig 18.10.2031 *	603	0,18	570 Point Au Roche Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class D1R, 144A, 6,109 %, fällig 20.01.2039 *	551	0,16
510 Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class D1R, 144A, 6,368 %, fällig 25.10.2038 *	513	0,15	1.230 PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.04.2038 *	1.238	0,37
440 Arini US Clo III Ltd 3A, Class E, 144A, 9,170 %, fällig 15.01.2039 *	443	0,13	373 RAMP Series 2006-NC3 Trust, Series 2006 NC3, Class M1, 4,298 %, fällig 25.03.2036 *	371	0,11
800 Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2024 2A, Class D, 144A, 7,430 %, fällig 20.10.2028	821	0,24	710 RR 18 Ltd, Series 2021 18A, Class DR, 144A, 8,572 %, fällig 15.07.2040 *	685	0,20
480 Bain Capital Credit CLO 2022-2 Ltd, Series 2022 2A, Class D1R, 144A, 6,869 %, fällig 22.04.2035 *	481	0,14	960 Sunrun Athena Issuer 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class A, 144A, 5,310 %, fällig 30.04.2049	944	0,28
175 Ballyrock CLO 26 Ltd, Series 2024 26A, Class D, 144A, 9,768 %, fällig 25.07.2037 *	175	0,05	640 Symphony CLO XXIV Ltd, Series 2020 24A, Class D1R, 144A, 6,471 %, fällig 23.10.2035 *	641	0,19
136 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 2,263 %, fällig 25.09.2034 *	138	0,04	735 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,071 %, fällig 23.07.2037 *	739	0,22
770 Capital Four US CLO Ltd, Series 2025 4A, Class E, 144A, 9,888 %, fällig 18.10.2038 *	772	0,23	470 Trinitas CLO XXVII Ltd, Series 2024 27A, Class D1, 144A, 7,968 %, fällig 18.04.2037 *	475	0,14
380 Captree Park CLO Ltd, Series 2024 1A, Class D, 144A, 6,918 %, fällig 20.07.2037 *	381	0,11	650 Valley Stream Park CLO Ltd, Series 2022 1A, Class DRR, 144A, 6,368 %, fällig 20.01.2037 *	651	0,19
500 Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,068 %, fällig 20.07.2037 *	505	0,15	533 WaMu Asset-Backed Certificates WaMu Series 2007-HE4 Trust, Series 2007 HE4, Class 1A, 3,958 %, fällig 25.07.2047 *	411	0,12
770 Carval CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.10.2037 *	773	0,23	800 Warwick Capital CLO 3 Ltd, Series 2024 3A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	808	0,24
9 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2005-D, Series 2005 D, Class 2A, 3,964 %, fällig 15.11.2035 *	9	–	330 Wellesley Park CLO Ltd, Series 2025 1A, Class E, 144A, 8,507 %, fällig 24.01.2039 *	322	0,10
366 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class B, 144A, 4,290 %, fällig 20.07.2038	352	0,10	750 Wellington Management Clo 2 Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 7,568 %, fällig 20.04.2037 *	757	0,22
570 Dryden 113 CLO Ltd, Series 2022 113A, Class D1R3, 144A, 6,672 %, fällig 15.10.2037 *	571	0,17	Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 31.947 \$)		31.475
622 Encore Credit Receivables Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M4, 4,718 %, fällig 25.11.2035 *	604	0,18	Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 20,76 % (28. Februar 2025: 17,56 %)		9,32
1.000 Flatiron CLO 28 Ltd, Series 2024 1A, Class D1R, 144A, 6,072 %, fällig 15.07.2036 *	1.001	0,30	1.000 280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class D, 144A, 5,505 %, fällig 15.09.2034 *	990	0,29
750 Golub Capital Partners CLO 53B Ltd, Series 2021 53A, Class ER, 144A, 8,368 %, fällig 20.07.2034 *	725	0,21	1.000 A10 2025-FL6 Issuer LLC, Series 2025 FL6, Class A, 144A, 5,145 %, fällig 15.05.2042 *	1.001	0,30
580 Golub Capital Partners CLO 60B Ltd, Series 2022 60A, Class DR, 144A, 6,628 %, fällig 25.10.2034 *	584	0,17	214 Alternative Loan Trust 2007-4CB, Series 2007 4CB, Class 1A5, 5,750 %, fällig 25.04.2037	181	0,05
420 Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 6,868 %, fällig 25.07.2037 *	423	0,13	1.020 Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2025-FL1 LLC, Series 2025 FL1, Class A, 144A, 5,021 %, fällig 20.01.2043 *	1.021	0,30
365 Goto Foods Funding LLC, Series 2017 1A, Class A2II, 144A, 5,093 %, fällig 30.04.2047	365	0,11	1.120 AREIT 2025-CRE11, Series 2025 CRE11, Class A, 144A, 5,210 %, fällig 25.07.2043 *	1.123	0,33
222 Home Equity Mortgage Loan Asset-Backed Trust Series INAB5 2005-C, Series 2005 C, Class M2, 4,538 %, fällig 25.10.2035 *	222	0,07	1.403 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A4, 3,175 %, fällig 15.09.2060	1.387	0,41
440 Invesco CLO 2021-3 Ltd, Series 2021 3A, Class DR, 144A, 6,769 %, fällig 22.10.2034 *	443	0,13	1.060 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class A5, 3,435 %, fällig 15.09.2060	1.049	0,31
470 Katayma CLO II Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	475	0,14	500 Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class D, 144A, 3,250 %, fällig 15.02.2050	468	0,14
168 Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class B, 144A, 3,450 %, fällig 20.12.2047	120	0,03	1.100 BWAY 2013-1515 Mortgage Trust, Series 2013 1515, Class F, 144A, 3,927 %, fällig 10.03.2033 *	945	0,28
138 Long Beach Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M4, 5,063 %, fällig 25.02.2035 *	137	0,04	1.030 BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Series 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041 *	1.012	0,30
429 Mastr Asset Backed Securities Trust 2007-HE2, Series 2007 HE2, Class A1, 4,938 %, fällig 25.08.2037 *	387	0,11	1.200 BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class D, 144A, 6,117 %, fällig 15.02.2042 *	1.208	0,36
933 Mosaic Solar Loan Trust 2022-1, Series 2022 1A, Class B, 144A, 3,160 %, fällig 20.01.2053	665	0,20	14 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 4,929 %, fällig 15.02.2038 *	14	–
188 National Collegiate Student Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class B, 4,168 %, fällig 26.03.2035 *	178	0,05	1.030 BXMT 2026-FL6 Ltd, Series 2026 FL6, Class A, 144A, 5,150 %, fällig 19.08.2043 *	1.032	0,31
672 National Collegiate Student Loan Trust 2006-3, Series 2006 3, Class B, 4,148 %, fällig 26.01.2032 *	637	0,19	645 Chase Mortgage Finance Corp, Series 2016 SH2, Class M4, 144A, 3,750 %, fällig 25.12.2045 *	610	0,18
289 National Collegiate Student Loan Trust 2007-2, Series 2007 2, Class A4, 4,078 %, fällig 25.01.2033 *	286	0,08	1.100 CIP Commercial Mortgage Trust 2025-SBAY, Series 2025 SBAY, Class E, 144A, 7,410 %, fällig 15.10.2037 *	1.105	0,33
1.299 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	156	0,05	399 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class B, 3,758 %, fällig 10.04.2048 *	386	0,11
450 Obra CLO 3 Ltd, Series 2025 3A, Class D1, 144A, 6,859 %, fällig 20.01.2039 *	449	0,13	800 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class C, 3,974 %, fällig 10.04.2048 *	731	0,22
800 Ocean Trails Clo X, Series 2020 10A, Class ER, 144A, 11,504 %, fällig 15.10.2034 *	759	0,23	432 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC33, Series 2015 GC33, Class B, 4,336 %, fällig 10.09.2058 *	420	0,12
370 Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class D1R, 144A, 7,168 %, fällig 20.07.2035 *	371	0,11	21 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class D, 144A, 3,225 %, fällig 15.09.2048	20	0,01
750 Ocp Clo 2024-33 Ltd, Series 2024 33A, Class E, 144A, 9,668 %, fällig 20.07.2037 *	758	0,23	260 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C1, Series 2016 C1, Class A4, 3,209 %, fällig 10.05.2049	260	0,08
470 OHA Credit Funding 11 Ltd, Series 2022 11A, Class D1R, 144A, 6,518 %, fällig 19.07.2037 *	472	0,14	17.373 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2016-C3, Series 2016 C3, Class XA, 0,885 %, fällig 15.11.2049 *	36	0,01
560 OHA Credit Funding 18 Ltd, Series 2024 18A, Class D1, 144A, 7,118 %, fällig 20.04.2037 *	567	0,17	1.400 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	1.386	0,41
500 OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D1, 144A, 6,568 %, fällig 20.07.2037 *	504	0,15	29.690 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class XA, 0,845 %, fällig 15.09.2050 *†	252	0,07
			575 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2018-C5, Series 2018 C5, Class A3, 3,963 %, fällig 10.06.2051	572	0,17

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
423 COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust, Series 2024 2, Class A3, 144A, 6,429 %, fällig 25.04.2069	427	0,13	501 Ginnie Mae II Pool 'MA8570', 5,500 %, fällig 20.01.2053	513	0,15
729 COLT 2025-6 Mortgage Loan Trust, Series 2025 6, Class A2, 144A, 5,783 %, fällig 25.08.2070	737	0,22	750 Greystone CRE Notes 2024-HC3, Series 2024 HC3, Class D, 144A, 8,992 %, fällig 15.03.2041 *	755	0,22
645 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R05, Series 2019 R05, Class 1B1, 144A, 7,882 %, fällig 25.07.2039 *	652	0,19	850 Greystone CRE Notes 2025 HC-4 LLC, Series 2025 HC4, Class AS, 144A, 5,900 %, fällig 15.10.2042 *	854	0,25
277 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 7,182 %, fällig 25.10.2039 *	281	0,08	1.350 Greystone CRE Notes 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,141 %, fällig 15.01.2043 *	1.355	0,40
650 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,032 %, fällig 25.01.2040 *	662	0,20	1.140 GS Mortgage Securities Corp Trust 2017-375H, Series 2017 375H, Class A, 144A, 3,475 %, fällig 10.09.2037 *	1.117	0,33
723 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 6,767 %, fällig 25.10.2041 *	733	0,22	1.280 GS Mortgage Securities Trust 2014-GC24, Series 2014 GC24, Class B, 4,498 %, fällig 10.09.2047 *	1.246	0,37
302 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1M2, 144A, 7,127 %, fällig 25.10.2041 *	303	0,09	4 GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Series 2015 GC32, Class D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	4	–
190 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 6,417 %, fällig 25.12.2041 *	192	0,06	41 GSMPS Mortgage Loan Trust 2006-RP1, Series 2006 RP1, Class 1A2, 144A, 7,500 %, fällig 25.01.2036	36	0,01
700 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1M2, 144A, 6,767 %, fällig 25.03.2042 *	715	0,21	700 Hilton USA Trust 2016-HHV, Series 2016 HHV, Class D, 144A, 4,194 %, fällig 05.11.2038 *	696	0,21
250 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R05, Series 2023 R05, Class 1M2, 144A, 6,767 %, fällig 25.06.2043 *	260	0,08	969 Impac Secured Assets Trust 2006-3, Series 2006 3, Class A7, 4,328 %, fällig 25.11.2036 *	875	0,26
760 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R06, Series 2023 R06, Class 1M2, 144A, 6,367 %, fällig 25.07.2043 *	781	0,23	615 IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR10, Series 2005 AR10, Class A2, 4,368 %, fällig 25.06.2035 *	457	0,14
780 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M2, 144A, 5,467 %, fällig 25.01.2044 *	786	0,23	340 J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2016-NINE, Series 2016 NINE, Class A, 144A, 2,854 %, fällig 06.09.2038 *	337	0,10
360 CSAIL 2017-C8 Commercial Mortgage Trust, Series 2017 C8, Class C, 4,253 %, fällig 15.06.2050 *	322	0,10	280 JP Morgan Resecuritization Trust Series 2009-10, Series 2009 10, Class 7A2, 144A, 6,054 %, fällig 26.02.2037 *	131	0,04
350 CSAIL 2018-CX12 Commercial Mortgage Trust, Series 2018 CX12, Class C, 4,722 %, fällig 15.08.2051 *	330	0,10	1.380 MF1 2024-FL16, Series 2024 FL16, Class A, 144A, 5,205 %, fällig 18.11.2039 *	1.385	0,41
1.130 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class F, 144A, 8,044 %, fällig 15.07.2032 *	1.131	0,33	1.210 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class A, 144A, 4,984 %, fällig 18.02.2040 *	1.211	0,36
500 CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,044 %, fällig 15.07.2032 *	483	0,14	660 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class D, 144A, 6,405 %, fällig 18.02.2040 *	660	0,20
519 DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 1A1B, 3,921 %, fällig 19.04.2047 *	416	0,12	240 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class E, 144A, 7,154 %, fällig 18.02.2040 *	239	0,07
1.100 Dwight 2025-FL1 Issuer LLC, Series 2025 FL1, Class A, 144A, 5,326 %, fällig 18.06.2042 *	1.104	0,33	400 MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042 *	402	0,12
2.410 Fannie Mae Pool 'FA0024', 2,000 %, fällig 01.08.2042	2.157	0,64	1.000 MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class D, 144A, 7,104 %, fällig 18.05.2042 *	1.003	0,30
1.211 Fannie Mae Pool 'FS2463', 3,000 %, fällig 01.02.2052	1.109	0,33	1.060 MF1 2026-FL21 LLC, Series 2026 FL21, Class A, 144A, 5,014 %, fällig 18.02.2041 *	1.061	0,31
49 First Franklin Mortgage Loan Trust 2003-FF4, Series 2003 FF4, Class M1, 5,586 %, fällig 25.10.2033 *	50	0,01	105 Morgan Stanley Capital I Trust 2015-UBS8, Series 2015 UBS8, Class C, 4,364 %, fällig 15.12.2048 *	104	0,03
1.053 Freddie Mac Mscr Trust MN2, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 7,017 %, fällig 25.07.2041 *	1.056	0,31	381 Morgan Stanley Capital I Trust 2018-MP, Series 2018 MP, Class A, 144A, 4,276 %, fällig 11.07.2040 *	356	0,11
747 Freddie Mac Pool 'QG1295', 5,500 %, fällig 01.04.2053	763	0,23	880 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	579	0,17
435 Freddie Mac Pool 'SD5876', 6,000 %, fällig 01.05.2054	454	0,13	361 Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	139	0,04
423 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	398	0,12	800 New Residential Mortgage Loan Trust 2016-3, Series 2016 3A, Class B2, 144A, 4,250 %, fällig 25.09.2056 *	795	0,24
700 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	696	0,21	523 OBX 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A3, 144A, 6,455 %, fällig 25.11.2063	527	0,16
893 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 2,900 %, fällig 25.11.2057 *	351	0,10	250 One Market Plaza Trust 2017-1MKT, Series 2017 1MKT, Class B, 144A, 3,845 %, fällig 10.02.2032	240	0,07
224 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25.08.2057 *	220	0,07	900 PFP 2026-13 Ltd, Series 2026 13, Class A, 144A, 5,166 %, fällig 18.08.2043 *	903	0,27
774 Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-4, Series 2018 4, Class M, 144A, 4,750 %, fällig 25.03.2058	770	0,23	817 PRKCM 2025-AFC1 Trust, Series 2025 AFC1, Class A1, 144A, 5,101 %, fällig 25.10.2060 *	823	0,24
680 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA6, Series 2020 DNA6, Class B1, 144A, 6,667 %, fällig 25.12.2050 *	726	0,21	213 Sequoia Mortgage Trust 2007-2, Series 2007 2, Class 1A3, 4,422 %, fällig 20.06.2036 *	201	0,06
200 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA2, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 5,967 %, fällig 25.08.2033 *	203	0,06	250 Starwood Retail Property Trust 2014-STAR, Series 2014 STAR, Class C, 144A, 6,750 %, fällig 15.11.2027 *†	8	–
580 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA3, Series 2021 DNA3, Class B1, 144A, 7,167 %, fällig 25.10.2033 *	656	0,19	1.150 STWD 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,116 %, fällig 19.11.2042 *	1.152	0,34
600 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B1, 144A, 6,717 %, fällig 25.01.2034 *	640	0,19	850 Towd Point Mortgage Trust 2015-5, Series 2015 5, Class B3, 144A, 3,978 %, fällig 25.05.2055 *	804	0,24
680 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B1, 144A, 7,067 %, fällig 25.10.2041 *	691	0,20	164 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	164	0,05
710 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B1, 144A, 8,417 %, fällig 25.02.2042 *	734	0,22	411 Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class A3, 144A, 6,968 %, fällig 25.12.2068	415	0,12
900 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M2, 144A, 7,417 %, fällig 25.02.2042 *	922	0,27	870 Verus Securitization Trust 2023-8, Series 2023 8, Class M1, 144A, 7,454 %, fällig 25.12.2068 *	884	0,26
900 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2025-DNA1, Series 2025 DNA1, Class M2, 144A, 5,017 %, fällig 25.01.2045 *	902	0,27	549 Verus Securitization Trust 2023-INV3, Series 2023 INV3, Class A3, 144A, 7,732 %, fällig 25.11.2068 *	557	0,16
485 Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2017-SPI1, Series 2017 SPI1, Class B, 144A, 4,107 %, fällig 25.09.2047 *	356	0,11	587 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class A3, 144A, 6,674 %, fällig 25.06.2069	595	0,18
506 Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	526	0,16	175 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	177	0,05
534 Ginnie Mae II Pool 'MA8347', 4,500 %, fällig 20.10.2052	533	0,16	769 Verus Securitization Trust 2025-4, Series 2025 4, Class A3, 144A, 5,753 %, fällig 25.05.2070	776	0,23
			66 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR17 Trust, Series 2005 AR17, Class A1C3, 4,748 %, fällig 25.12.2045 *	77	0,02
			2.016 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR2 Trust, Series 2005 AR2, Class B1, 4,583 %, fällig 25.01.2045 *	1.867	0,55

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
254 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2006-AR13 Trust, Series 2006 AR13, Class 2A, 5,415 %, fällig 25.10.2046 *	245	0,07	730 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 04.12.2029	714	0,21
294 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,137 %, fällig 15.05.2048 *	283	0,08	290 Melco Resorts Finance Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 24.09.2033	289	0,09
672 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2017-C38, Series 2017 C38, Class A4, 3,190 %, fällig 15.07.2050	665	0,20		1.003	0,30
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 69.313 \$)	70.110	20,76	Hongkong – 0,30 % (28. Februar 2025: 0,34 %)		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 53,31 % (28. Februar 2025: 51,96 %)			Irland – 0,44 % (28. Februar 2025: 0,28 %)		
Argentinien – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,42 %)			350 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	327	0,10
420 Pampa Energia SA, 144A, 7,950 %, fällig 10.09.2031	436	0,13	410 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 6,950 %, fällig 10.03.2055 *	434	0,13
30 Pampa Energia SA, 144A, 7,875 %, fällig 16.12.2034	31	0,01	730 Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	728	0,21
200 Pan American Energy LLC/Argentina, 144A, 8,500 %, fällig 30.04.2032	214	0,06		1.489	0,44
200 YPF SA, 144A, 6,950 %, fällig 21.07.2027	203	0,06	Israel – 0,61 % (28. Februar 2025: 0,68 %)		
	884	0,26	2.660 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	2.046	0,61
Brasilien – 0,59 % (28. Februar 2025: 0,52 %)			Italien – 0,40 % (28. Februar 2025: 0,49 %)		
460 B3 SA – Brasil Bolsa Balcao, 144A, 4,125 %, fällig 20.09.2031	436	0,13	1.080 Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 7,800 %, fällig 28.11.2053	1.345	0,40
370 MercadoLibre Inc, 3,125 %, fällig 14.01.2031	346	0,10	Kasachstan – 0,07 % (28. Februar 2025: 0,05 %)		
200 MercadoLibre Inc, 4,900 %, fällig 15.01.2033	199	0,06	230 QazaqGaz NC JSC, 144A, 4,375 %, fällig 26.09.2027	230	0,07
490 Petrobras Global Finance BV, 6,850 %, fällig 05.06.2115	473	0,14	Kuwait – 0,17 % (28. Februar 2025: 0,13 %)		
610 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	553	0,16	530 MEGlobal Canada ULC, 144A, 5,875 %, fällig 18.05.2030	557	0,17
	2.007	0,59	Luxemburg – 0,45 % (28. Februar 2025: 0,68 %)		
Kanada – 1,67 % (28. Februar 2025: 1,99 %)			1.960 Altice Financing SA, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2029	1.360	0,40
640 Bank of Nova Scotia/The, 8,000 %, fällig 27.01.2084 *	685	0,20	170 Altice France Lux 3 / Altice Holdings 1, 144A, 10,000 %, fällig 15.01.2033	160	0,05
50 Bausch Health Cos Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2028	45	0,02		1.520	0,45
230 Bausch Health Cos Inc, 144A, 11,000 %, fällig 30.09.2028	241	0,07	Macao – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,34 %)		
100 Bausch Health Cos Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.02.2029	79	0,03	480 Sands China Ltd, 5,400 %, fällig 08.08.2028	490	0,15
710 Bombardier Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.06.2032	749	0,22	200 Sands China Ltd, 2,850 %, fällig 08.03.2029	192	0,06
270 Capstone Copper Corp, 144A, 6,750 %, fällig 31.03.2033	279	0,08	200 Sands China Ltd, 3,250 %, fällig 08.08.2031	186	0,05
370 Empire Communities Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.05.2029	383	0,11		868	0,26
280 Hudbay Minerals Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.04.2026	281	0,08	Malaysia – 0,05 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
460 Hudbay Minerals Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2029	464	0,14	217 Axiata Spv5 Labuan Ltd, 3,064 %, fällig 19.08.2050	160	0,05
250 Superior Plus LP / Superior General Partner Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.03.2029	243	0,07	Mexiko – 0,47 % (28. Februar 2025: 0,32 %)		
600 Toronto-Dominion Bank/The, 8,125 %, fällig 31.10.2082 *	628	0,19	800 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 7,500 %, Ewige Anleihe *	827	0,24
780 TransAlta Corp, 6,500 %, fällig 15.03.2040	788	0,23	570 Grupo Televisa SAB, 5,000 %, fällig 13.05.2045	391	0,12
800 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	783	0,23	380 Trust 2401, 144A, 4,869 %, fällig 15.01.2030	376	0,11
	5.648	1,67		1.594	0,47
Chile – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,13 %)			Marokko – 0,23 % (28. Februar 2025: 0,24 %)		
200 AES Andes SA, 144A, 6,250 %, fällig 14.03.2032	208	0,06	730 OCP SA, 144A, 6,750 %, fällig 02.05.2034	791	0,23
320 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	334	0,10	Niederlande – 0,21 % (28. Februar 2025: 0,50 %)		
	542	0,16	400 Cooperatieve Rabobank UA, 4,875 %, Ewige Anleihe *	485	0,14
China – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,14 %)			230 VZ Secured Financing BV, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2033	226	0,07
451 Country Garden Holdings Co Ltd, Nullkupon, fällig 31.12.2031	55	0,02		711	0,21
217 Country Garden Holdings Co Ltd, Series REG, 5,000 %, fällig 31.12.2032	31	0,01	Peru – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,03 %)		
570 Prosus NV, 144A, 3,061 %, fällig 13.07.2031	526	0,15	200 Petroleos del Peru SA, 144A, 5,625 %, fällig 19.06.2047	128	0,04
	612	0,18	Singapur – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,16 %)		
Kolumbien – 0,23 % (28. Februar 2025: 0,23 %)			640 Puma International Financing SA, 144A, 7,750 %, fällig 25.04.2029	664	0,20
740 Ecopetrol SA, 8,375 %, fällig 19.01.2036	761	0,23	Südafrika – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,07 %)		
Frankreich – 0,50 % (28. Februar 2025: 1,10 %)			310 Sasol Financing USA LLC, 5,500 %, fällig 18.03.2031	272	0,08
152 Altice France SA, 144A, 9,500 %, fällig 01.11.2029	155	0,04	Supranational – 0,64 % (28. Februar 2025: 0,77 %)		
831 Altice France SA, 144A, 6,500 %, fällig 15.04.2032	796	0,24	INR 194.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	2.169	0,64
389 Altice France SA, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	374	0,11	Schweden – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,12 %)		
350 BNP Paribas SA, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	373	0,11	200 Stena International SA, 144A, 7,250 %, fällig 15.01.2031	206	0,06
	1.698	0,50	Schweiz – 0,73 % (28. Februar 2025: 0,85 %)		
Deutschland – 0,86 % (28. Februar 2025: 0,79 %)			460 UBS Group AG, 144A, 7,750 %, Ewige Anleihe *	493	0,15
660 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	677	0,20	590 UBS Group AG, 144A, 9,250 %, Ewige Anleihe *	644	0,19
560 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,125 %, fällig 14.04.2030	573	0,17	710 UBS Group AG, 144A, 7,000 %, Ewige Anleihe *	726	0,21
1.220 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	1.233	0,37	590 UBS Group AG, 144A, 7,125 %, Ewige Anleihe *	605	0,18
410 ZF North America Capital Inc, 144A, 7,500 %, fällig 24.03.2031	423	0,12		2.468	0,73
	2.906	0,86	Türkei – 0,28 % (28. Februar 2025: 0,23 %)		
Guatemala – 0,19 % (28. Februar 2025: 0,16 %)			900 Türk Telekomunikasyon AS, 144A, 7,375 %, fällig 20.05.2029	942	0,28
315 Millicom International Cellular SA, 144A, 6,250 %, fällig 25.03.2029	318	0,09	Vereinigte Arabische Emirate – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,22 %)		
363 Millicom International Cellular SA, 144A, 4,500 %, fällig 27.04.2031	339	0,10	260 DP World Ltd/United Arab Emirates, 144A, 5,625 %, fällig 25.09.2048	255	0,07
	657	0,19	64 Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd, 1,750 %, fällig 30.09.2027	62	0,02
				317	0,09

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
540 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	544	0,16	230 Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2033	212	0,06
520 JB Poindexter & Co Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2031	539	0,16	240 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2038	263	0,08
1.160 Kingpin Intermediate Holdings LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.10.2032	1.080	0,32	550 Rockies Express Pipeline LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2040	567	0,17
480 Ladder Capital Finance Holdings LLP / Ladder Capital Finance Corp, 144A, 7,000 %, fällig 15.07.2031	506	0,15	660 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 30.09.2031	680	0,20
560 LD Holdings Group LLC, 144A, 6,125 %, fällig 01.04.2028	499	0,15	260 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	271	0,08
330 Level 3 Financing Inc, 144A, 6,875 %, fällig 30.06.2033	342	0,10	530 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	549	0,16
510 Level 3 Financing Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2036	532	0,16	790 RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	815	0,24
750 LifePoint Health Inc, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	801	0,24	10 Sealed Air Corp/Sealed Air Corp US, 144A, 6,125 %, fällig 01.02.2028	10	–
420 Light & Wonder International Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.10.2033	422	0,13	470 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2032	460	0,14
1.540 Lightning Power LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2032	1.636	0,48	170 Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2033	199	0,06
370 LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.03.2029	365	0,11	520 Simmons Foods Inc/Simmons Prepared Foods Inc/ Simmons Pet Food Inc/Simmons Feed, 144A, 4,625 %, fällig 01.03.2029	502	0,15
7.031 McClatchy Media Co LLC, 144A, 11,000 %, fällig 01.12.2031 †	7.945	2,35	250 Six Flags Entertainment Corp/Canada's Wonderland Co/Millennium Operations LLC, 144A, 8,625 %, fällig 15.01.2032	253	0,08
90 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	93	0,03	410 Sotera Health Holdings LLC, 144A, 7,375 %, fällig 01.06.2031	432	0,13
1.000 Meta Platforms Inc, 5,500 %, fällig 15.11.2045	989	0,29	420 Sprint Capital Corp, 8,750 %, fällig 15.03.2032	513	0,15
220 Michaels Cos Inc/The, 144A, 5,250 %, fällig 01.05.2028	220	0,07	330 Starwood Property Trust Inc, 144A, 7,250 %, fällig 01.04.2029	346	0,10
100 Michaels Cos Inc/The, 144A, 7,875 %, fällig 01.05.2029	101	0,03	340 Stonex Escrow Issuer LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	353	0,10
350 Michaels Cos Inc/The, 144A, 8,500 %, fällig 15.03.2033	341	0,10	490 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2031	494	0,15
780 Michaels Cos Inc/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.03.2034	730	0,22	490 Sunoco LP, 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2034	491	0,15
830 Midcap Financial Issuer Trust, 144A, 7,422 %, fällig 15.01.2056 *	818	0,24	208 Super Micro Computer Inc, 3,500 %, fällig 01.03.2029	194	0,06
700 Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	719	0,21	880 SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	885	0,26
200 Millrose Properties Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2032	203	0,06	530 Talen Energy Supply LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.02.2036	545	0,16
52 MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 5,750 %, fällig 31.12.2030	38	0,01	260 Tallgrass Energy Partners LP / Tallgrass Energy Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 31.12.2030	264	0,08
84 MPH Acquisition Holdings LLC, 144A, 11,500 %, fällig 31.12.2030	75	0,02	530 TEAM Services Holding Inc, 144A, 9,000 %, fällig 15.02.2033	519	0,15
470 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 5,000 %, fällig 15.10.2027	461	0,14	310 Time Warner Cable LLC, 6,750 %, fällig 15.06.2039	318	0,09
140 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 3,692 %, fällig 05.06.2028	171	0,05	400 TKC Holdings Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.08.2030	410	0,12
400 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 4,625 %, fällig 01.08.2029	346	0,10	210 TopBuild Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.02.2032	200	0,06
450 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 144A, 8,500 %, fällig 15.02.2032	482	0,14	780 TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 31.01.2034	787	0,23
610 Nabors Industries Inc, 144A, 8,875 %, fällig 15.08.2031	632	0,19	730 TransDigm Inc, 144A, 6,625 %, fällig 01.03.2032	757	0,22
1.170 NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	1.206	0,36	420 TransDigm Inc, 144A, 6,125 %, fällig 31.07.2034	427	0,13
330 Neptune Bidco US Inc, 144A, 10,375 %, fällig 15.05.2031	333	0,10	300 Truist Financial Corp, 5,122 %, fällig 26.01.2034 *	308	0,09
280 Neptune Bidco US Inc, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2033	274	0,08	300 Truist Financial Corp, 5,867 %, fällig 08.06.2034 *	321	0,10
974 New Generation Gas Gathering LLC, 144A, 9,410 %, fällig 30.09.2029 *†∞	1.013	0,30	1.460 Tutor Perini Corp, 144A, 11,875 %, fällig 30.04.2029	1.602	0,47
340 Noble Finance II LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2030	354	0,11	320 United Airlines Holdings Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2031	327	0,10
500 Northern Oil & Gas Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.10.2033	511	0,15	1.600 United Rentals North America Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.12.2029	1.642	0,49
2.790 Northwest Acquisitions ULC / Dominion Fincio Inc, 144A, 7,125 %, fällig 01.11.2022 ∞e	–	–	180 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2029	175	0,05
300 NRG Energy Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2034	304	0,09	340 Uniti Group LP / Uniti Group Finance 2019 Inc / CSL Capital LLC, Series Feb, 144A, 8,625 %, fällig 15.06.2032	345	0,10
350 NRG Energy Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.11.2034	362	0,11	396 US Renal Care Inc, 144A, 10,625 %, fällig 28.06.2028	330	0,10
1.460 NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	1.487	0,44	580 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 4,125 %, fällig 15.08.2031	544	0,16
640 Occidental Petroleum Corp, 6,450 %, fällig 15.09.2036	697	0,21	290 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 01.11.2033	258	0,08
1.260 Occidental Petroleum Corp, 7,950 %, fällig 15.06.2039	1.523	0,45	1.350 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.02.2029	1.449	0,43
740 Oracle Corp, 4,950 %, fällig 04.02.2031	739	0,22	1.040 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	910	0,27
210 Oracle Corp, 5,350 %, fällig 04.05.2033	211	0,06	10 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.12.2030	10	–
300 Oracle Corp, 5,700 %, fällig 04.02.2036	300	0,09	2.210 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	2.355	0,70
800 Park-Ohio Industries Inc, 144A, 8,500 %, fällig 01.08.2030	831	0,25	229 Vericast Corp/Harland Clarke/Checks in the Mail/ Valassis Comm/Valassis Direct, 144A, 13,000 %, fällig 15.12.2030	282	0,08
1.210 PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 6,000 %, fällig 15.02.2028	1.206	0,36	310 Versant Media Group Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.01.2031	317	0,09
630 Permian Resources Operating LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.07.2029	632	0,19	610 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	608	0,18
1.410 Permian Resources Operating LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2032	1.481	0,44	470 VFH Parent LLC / Valor Co-Issuer Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.06.2031	491	0,15
50 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	52	0,02	380 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	380	0,11
420 Petco Health & Wellness Co Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.02.2031	410	0,12	710 Viking Cruises Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2029	712	0,21
680 Plains All American Pipeline LP, Series B, 8,024 %, Ewige Anleihe *	680	0,20	870 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	926	0,27
2.385 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	2.233	0,66	600 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2033	612	0,18
410 Qnity Electronics Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.08.2032	420	0,12	370 Vistra Operations Co LLC, 144A, 4,375 %, fällig 01.05.2029	366	0,11
350 Qnity Electronics Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.08.2033	364	0,11	420 Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2032	442	0,13
790 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	822	0,24	800 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	800	0,24
290 Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	294	0,09	508 Vortex Opco LLC, 144A, 8,000 %, fällig 30.04.2030 †e	9	–
470 Range Resources Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.02.2030	466	0,14			
610 Rivers Enterprise Borrower LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.10.2030	624	0,18			
550 Rocket Cos Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.08.2030	565	0,17			

[^] 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 2026 – (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)					
430 WBI Operating LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.10.2033	437	0,13	Jamaika – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,05 %)		
550 WESCO Distribution Inc, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2034	556	0,16	JMD 30.000 Internationale Staatsanleihe Jamaika, 6,625 %, fällig 11.12.2024	204	0,06
1.190 Western Midstream Operating LP, 5,450 %, fällig 01.04.2044	1.097	0,33	Jordanien – 0,24 % (28. Februar 2025: 0,19 %)		
680 Western Midstream Operating LP, 5,300 %, fällig 01.03.2048	601	0,18	560 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 144A, 7,750 %, fällig 15.01.2028	586	0,18
220 Williams Cos Inc/The, 8,750 %, fällig 15.03.2032	269	0,08	200 Internationale Staatsanleihe Jordanien, 7,500 %, fällig 13.01.2029	210	0,06
500 WULF Compute LLC, 144A, 7,750 %, fällig 15.10.2030	530	0,16		796	0,24
710 Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp, 144A, 7,125 %, fällig 15.02.2031	767	0,23	Kenia – 0,15 % (28. Februar 2025: 0,32 %)		
	134.740	39,91	300 Internationale Anleihe der Republik Kenia, 144A, 9,750 %, fällig 16.02.2031	329	0,10
Sambia – 0,95 % (28. Februar 2025: 0,76 %)			200 Internationale Anleihe der Republik Kenia, 6,300 %, fällig 23.01.2034	180	0,05
800 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.03.2033	855	0,25		509	0,15
1.960 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2034	2.054	0,61	Mexiko – 0,70 % (28. Februar 2025: 0,58 %)		
310 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2036	311	0,09	260 Eagle Funding Luxco Srl, 144A, 5,500 %, fällig 17.08.2030	265	0,08
	3.220	0,95	MXN 13.270 Mexiko, Bonos, Serie M, 5,750 %, fällig 05.03.2026	769	0,23
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 179.491 \$)			MXN 4.410 Mexiko, Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 23.11.2034	245	0,07
	179.995	53,31	710 Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 6,000 %, fällig 07.05.2036	729	0,21
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 4,23 % (28. Februar 2025: 4,02 %)			440 Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 4,750 %, fällig 08.03.2044	367	0,11
Angola – 0,27 % (28. Februar 2025: 0,15 %)				2.375	0,70
250 Angola, Internationale Staatsanleihe, 144A, 8,000 %, fällig 26.11.2029	249	0,08	Mosambik – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
460 Internationale Staatsanleihe Angola, 144A, 8,750 %, fällig 14.04.2032	452	0,13	220 Internationale Anleihe Mosambik, 9,000 %, fällig 15.09.2031	187	0,06
230 Internationale Anleihe der Regierung von Angola, 9,125 %, fällig 26.11.2049	204	0,06	Nigeria – 0,18 % (28. Februar 2025: 0,13 %)		
	905	0,27	340 Internationale Anleihe der nigerianischen Regierung, 7,143 %, fällig 23.02.2030	351	0,11
Argentinien – 0,31 % (28. Februar 2025: 0,78 %)			260 Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,625 %, fällig 28.11.2047	247	0,07
5 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 1,000 %, fällig 09.07.2029	5	–		598	0,18
34 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 0,750 %, fällig 09.07.2030	29	0,01	Paraguay – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
1.289 Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	1.025	0,30	200 Paraguay, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,650 %, fällig 04.03.2055	220	0,06
	1.059	0,31	Rumänien – 0,14 % (28. Februar 2025: 0,11 %)		
Bahamas – 0,19 % (28. Februar 2025: 0,15 %)			430 Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,500 %, fällig 10.02.2037	489	0,14
400 Bahamas, Internationale Staatsanleihe, 144A, 6,000 %, fällig 21.11.2028	400	0,12	Senegal – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
220 Internationale Anleihe der Regierung der Bahamas, 8,950 %, fällig 15.10.2032	250	0,07	200 Internationale Staatsanleihe Senegal, 6,250 %, fällig 23.05.2033	125	0,04
	650	0,19	Sri Lanka – 0,05 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
Brasilien – 0,43 % (28. Februar 2025: 0,41 %)			20 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 4,000 %, fällig 15.04.2028	20	–
BRL 8.261 Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2031	1.442	0,43	22 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,100 %, fällig 15.01.2030	22	0,01
Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,34 %)			43 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,350 %, fällig 15.03.2033	40	0,01
900 Côte d'Ivoire, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,625 %, fällig 30.01.2033	965	0,29	29 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.06.2035	23	0,01
Dominikanische Republik – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,25 %)			20 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.05.2036	20	0,01
160 Dominikanische Republik, Internationale Anleihe, 4,500 %, fällig 30.01.2030	157	0,05	40 Sri Lanka, Internationale Staatsanleihe, 144A, 3,600 %, fällig 15.02.2038	40	0,01
740 Dominican Republic International Bond, 4,875 %, fällig 23.09.2032	714	0,21		165	0,05
	871	0,26	Ukraine – 0,11 % (28. Februar 2025: 0,09 %)		
Ecuador – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			22 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2030	14	–
310 Ecuador, Internationale Staatsanleihe, 144A, 8,750 %, fällig 29.01.2034	313	0,09	80 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2034	40	0,01
Ägypten – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,05 %)			79 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 01.02.2034	49	0,02
260 Internationale Anleihe der ägyptischen Regierung, 7,053 %, fällig 15.01.2032	262	0,08	68 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2035	39	0,01
El Salvador – 0,22 % (28. Februar 2025: 0,17 %)			138 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 01.02.2035	85	0,03
210 Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 9,250 %, fällig 17.04.2030	228	0,07	57 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 0,000 %, fällig 01.02.2036	32	0,01
440 Internationale Staatsanleihe El Salvador, 144A, 9,650 %, fällig 21.11.2054	501	0,15	177 Ukraine, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 01.02.2036	107	0,03
	729	0,22		366	0,11
Äthiopien – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,06 %)			USA – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
270 Föderale Republik Äthiopien, 0,000 %, fällig 11.12.2026	281	0,08	240 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 28.02.2030	245	0,07
Ghana – 0,03 % (28. Februar 2025: 0,03 %)			190 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030 ±	193	0,06
2 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, Nullkupon, fällig 03.07.2026	2	–		438	0,13
47 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, 5,000 %, fällig 03.07.2029	46	0,01	Usbekistan – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,04 %)		
77 Ghana, Internationale Staatsanleihe, 144A, 5,000 %, fällig 03.07.2035	69	0,02	220 Internationale Anleihe der Republik Usbekistan, 3,900 %, fällig 19.10.2031	207	0,06
	117	0,03	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 13.085 \$)		
				14.273	4,23

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Schuldscheindarlehen – 6,04 % (28. Februar 2025: 6,68 %)			Optionsscheine – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
299 1261229 Bc Ltd, 9,922 %, fällig 25.09.2030 *	292	0,09	USA – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
307 A-AP Buyer Inc, 6,417 %, fällig 09.09.2031 *	307	0,09	32 Spirit Aviation Holdings †∞	16	–
336 ABG Intermediate Holdings, 5,922 %, fällig 12.02.2032 *	334	0,10	4 Spirit Aviation Holdings †∞	2	–
450 Acrisure, 6,672 %, fällig 06.11.2030 *	437	0,13	48 Spirit Aviation Holdings †∞	23	0,01
85 Allen Media LLC, 9,322 %, fällig 10.02.2027 *	51	0,02	3 Spirit Aviation Holdings †∞	1	–
323 Allwyn Entertainment Financing, 5,667 %, fällig 11.06.2031 *	313	0,09		42	0,01
277 AmWINS Group Inc, 5,672 %, fällig 30.01.2032 *	275	0,08	Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 1.142 \$)		
236 Ascensus Holdings Inc, 6,672 %, fällig 20.11.2032 *	231	0,07		42	0,01
556 Asurion LLC, 0,000 %, fällig 14.02.2033 *	547	0,16	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 316.741 \$)		
309 Autokiniton U.S. Holdings, 7,786 %, fällig 06.04.2028 *	309	0,09		316.685	93,79
200 Aveanna Healthcare, 7,422 %, fällig 13.09.2032 *	199	0,06	Credit Default Swaps – 0,03 % (28. Februar 2025: 0,03 %)		
240 Calabrio Inc, 7,835 %, fällig 25.10.2032 *	194	0,06	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	89	0,03
194 Celsius Holdings Inc, 6,172 %, fällig 01.04.2032 *	195	0,06	Index-Swaps – 0,13 % (28. Februar 2025: 0,02 %)		
890 CFC USA 2025 LLC, 7,161 %, fällig 30.05.2032 *	852	0,25	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	434	0,13
520 Cloud Software Group Inc, 0,000 %, fällig 24.03.2031 *	485	0,14	Zinsswaps – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
190 Cloudera Inc, 7,566 %, fällig 10.10.2028 *	169	0,05	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	57	0,01
765 DCert Buyer, Inc., 10,672 %, fällig 16.02.2029 *	619	0,18	Devisenterminkontrakte – 0,05 % (28. Februar 2025: 1,22 %)		
778 DS Parent Inc, 9,172 %, fällig 16.12.2030 *	700	0,21	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	177	0,05
252 Evertex Group LLC, 5,922 %, fällig 15.10.2030 *	252	0,07	Futures – 0,11 % (28. Februar 2025: 0,18 %)		
129 First Brands Group LLC, 13,671 %, fällig 01.10.2026 *	25	0,01	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	366	0,11
162 First Brands Group LLC, 10,786 %, fällig 24.03.2027 *†	1	–	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
368 First Brands Group LLC, 10,671 %, fällig 29.06.2026 *	2	–		317.808	94,12
126 First Brands Group LLC, 10,786 %, fällig 30.03.2027 *†	–	–	Credit Default Swaps – 0,03 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
66 First Eagle, 1,750 %, fällig 06.06.2032 *	64	0,02	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-97	-0,03
384 First Eagle, 7,172 %, fällig 06.06.2032 *	377	0,11	Zinsswaps – -0,16 % (28. Februar 2025: -0,19 %)		
79 Focus Financial Partners LLC, 6,172 %, fällig 15.09.2031 *	75	0,02	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-548	-0,16
420 Gen Digital Inc, 0,000 %, fällig 12.09.2029 *	410	0,12	Devisenterminkontrakte – -1,35 % (28. Februar 2025: -0,15 %)		
5 Gray Television, 8,921 %, fällig 23.05.2029 *	5	–	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-4.560	-1,35
604 Greystone Select Financial, 8,931 %, fällig 06.05.2028 *	592	0,18	Futures – 0,00 % (28. Februar 2025: -0,11 %)		
463 Hexion Holdings Corp, 7,677 %, fällig 15.03.2029 *	455	0,14	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-6	–
730 Hopper Merger Sub Inc, 0,000 %, fällig 14.01.2033 *	722	0,21	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
348 HP PHRG Borrower LLC, 7,672 %, fällig 20.02.2032 *	346	0,10		-5.211	-1,54
107 Hyperion Refinance S.a.r.l., 6,422 %, fällig 18.04.2030 *	103	0,03	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
450 Jane Street Group LLC, 5,822 %, fällig 15.12.2031 *	437	0,13		312.597	92,58
178 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 5,922 %, fällig 05.05.2028 *	179	0,05	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
100 Kingpin Intermediate Holding LLC, 6,922 %, fällig 16.09.2032 *	94	0,03		25.040	7,42
170 Kodiak BP LLC, 7,422 %, fällig 04.12.2031 *	170	0,05	Gesamtvermögen		
274 Learfield Communications LLC, 8,422 %, fällig 30.06.2028 *	275	0,08		337.637 \$	100,00
379 LifePoint Health Inc, 7,422 %, fällig 14.05.2031 *	380	0,11	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %. 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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 221.660.000 \$ und machten 65,65 % des Nettovermögens aus. * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026. † Nicht liquide. ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet. ε Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen). ≠ Das Wertpapier (in seiner Gesamtheit oder in Teilen) ist zum 28. Februar 2026 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet. ABKÜRZUNGEN: Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen. REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit BRL – Brasilianischer Real EUR – Euro GBP – Britisches Pfund Sterling HKD – Hongkong-Dollar INR – Indische Rupie JMD – Jamaikanischer Dollar MXN – Mexikanischer Peso		
227 LifePoint Health Inc, 7,152 %, fällig 19.05.2031 *	227	0,07			
80 Medline Borrower LP, 5,422 %, fällig 23.10.2028 *	80	0,02			
468 MH Sub I LLC, 7,922 %, fällig 03.05.2028 *	384	0,11			
317 MH Sub I LLC, 7,922 %, fällig 31.12.2031 *	218	0,06			
314 Natgasoline LLC, 9,172 %, fällig 25.03.2030 *	317	0,09			
439 Nexus Buyer LLC, 7,172 %, fällig 31.07.2031 *	414	0,12			
279 Osmose Utilities Services Inc, 7,036 %, fällig 22.06.2028 *	271	0,08			
436 Peer Holding III Bv, 6,172 %, fällig 01.07.2031 *	436	0,13			
200 Peer USA LLC, 5,922 %, fällig 25.09.2032 *	200	0,06			
620 Petco Health & Wellness Co Inc, 7,921 %, fällig 22.01.2031 *	598	0,18	Verteilung des Gesamtvermögens		
506 Polyconcept North America Holdings Inc, 9,172 %, fällig 12.05.2029 *	460	0,14	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,66	
170 Relativity Intermediate Holdco LLC, 6,410 %, fällig 18.01.2033 *	166	0,05	Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	5,83	
581 Sedgwick Claims Management Services, 6,172 %, fällig 31.07.2031 *	564	0,17	Finanzderivate	0,32	
380 Starwood Property Mortgage LLC, 5,422 %, fällig 18.11.2027 *	380	0,11	Sonstige Vermögenswerte	9,19	
270 Talen Energy, 5,672 %, fällig 09.10.2032 *	271	0,08	Gesamtvermögen		
500 Team Services Holding Inc, 0,000 %, fällig 31.01.2033 *	472	0,14		100,00	
330 TransDigm Inc, 6,160 %, fällig 10.02.2033 *	331	0,10			
290 Two Kings Casino, 8,417 %, fällig 16.12.2031 *	296	0,09			
480 UKG Inc, 6,167 %, fällig 10.02.2031 *	456	0,14			
895 WW International Inc, 10,489 %, fällig 24.06.2030 *	769	0,23			
762 X Corp, 10,590 %, fällig 29.10.2029 *	765	0,23			
815 XAI Corp, 11,122 %, fällig 28.06.2030 *	846	0,25			
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 21.521 \$)		20.394			
Stammaktien – 0,12 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
China – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
HKD 2 Country Garden Holdings Co Ltd	–	–			
Luxemburg – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
EUR 1 Altice France CVR †ε	13	–			
EUR 16 Altice France Lux 3 †ε	293	0,09			
	306	0,09			
Schweiz – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
1.310 Credit Suisse Group AG Escrow †∞	–	–			
USA – 0,03 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
4 WW International Inc	90	0,03			
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 242 \$)		396			

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Kauf	20. Dez. 2030	1.416	\$ -97
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	4.548	89
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 118 \$)				\$ 89
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-97
Nettowertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 118 \$)				\$ -8

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 12,320 %	03. Jan. 2033	22.990	\$ -135
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	02. Jan. 2029	23.600	-413
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,250 %	02. Jan. 2031	13.153	20
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,300 %	02. Jan. 2031	20.400	37
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 57
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -774 \$)				-548
Nettowertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -774 \$)				\$ -491

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	Zahlt variablen Zinssatz zum MXN TIIE ON-OIS Compound, erhält festen Zinssatz von 8,885 %	10. Nov. 2034	87.190	\$ 434
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 89 \$)				\$ 434
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 89 \$)				\$ 434

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.424	Verkauf	BRL	7.822	\$ -101
03. März 2026	JP Morgan	Kauf	BRL	7.822	Verkauf	USD	1.512	14
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	9.416	Verkauf	EUR	7.937	32
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	835	Verkauf	GBP	616	4
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	29	Verkauf	GBP	22	–
13. März 2026	BNY	Kauf	JPY	3.857.610	Verkauf	USD	24.817	-89
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	151	Verkauf	USD	178	–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	18.202	Verkauf	USD	21.715	-193
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	3	Verkauf	USD	4	–
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	191.195	Verkauf	USD	261.515	-3.841
13. März 2026	BNY	Kauf	CHF	3.511	Verkauf	USD	4.597	-23
13. März 2026	BNY	Kauf	CAD	26.342	Verkauf	USD	19.435	-114
16. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	1.490	Verkauf	MXN	27.027	-73
16. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	EUR	1.644	Verkauf	USD	1.950	-2
16. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	INR	17.131	Verkauf	USD	188	-1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	563	Verkauf	EUR	475	1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	802	Verkauf	EUR	680	-4
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	3.767	Verkauf	GBP	2.797	-3
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	–	Verkauf	JPY	10	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	310	Verkauf	USD	367	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	AUD	1.380	Verkauf	USD	979	3
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	210	Verkauf	USD	250	-1
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	227	Verkauf	AUD	330	-8
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	898	Verkauf	CAD	1.235	-9
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	1.618	Verkauf	EUR	1.376	-10
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	2.400	Verkauf	INR	217.540	19
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	EUR	300	Verkauf	USD	349	6
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	CNH	2.948	Verkauf	USD	426	5
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	1.563	Verkauf	AUD	2.286	-65
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	848	Verkauf	CNH	5.878	-11
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	CNH	2.930	Verkauf	USD	423	5
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	AUD	2.347	Verkauf	USD	1.582	88
02. Jun. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	1.480	Verkauf	BRL	7.822	-12
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 4.968 \$)								\$ 177
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -630 \$)								-4.560
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 4.338 \$)								\$ -4.383

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3 Month SOFR Index Dezember 2026	Bank of America Merrill Lynch	-28	\$ -6.786	\$ -6
Australia 10 Year Bond März 2026	Bank of America Merrill Lynch	45	3.541	47
Euro-Bund März 2026	Bank of America Merrill Lynch	15	2.308	28
Long Gilt Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	12	1.515	20
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	120	13.658	90
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	85	17.788	28
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	129	14.208	58
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	47	5.568	55
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	24	2.918	40
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 729 \$)				\$ 366
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -428 \$)				-6
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 301 \$)				\$ 360

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 20,40 % (28. Februar 2025: 17,12 %)					
890 Abry Liquid Credit CLO 2025-2 Ltd, Series 2025 2A, Class D, 144A, 6,835 %, fällig 15.01.2039 *	900	0,17	710 Invesco CLO 2021-3 Ltd, Series 2021 3A, Class DR, 144A, 6,769 %, fällig 22.10.2034 *	715	0,14
968 Accredited Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class M5, 5,535 %, fällig 25.04.2035 *	1.009	0,19	640 Katayma CLO II Ltd, Series 2024 2A, Class D, 144A, 8,168 %, fällig 20.04.2037 *	646	0,12
320 AIMCO CLO 16 Ltd, Series 2021 16A, Class D1R, 144A, 6,568 %, fällig 17.07.2037 *	323	0,06	1.430 Kinetic ABS Issuer LLC, Series 2026 1A, Class C, 144A, 7,653 %, fällig 25.02.2056	1.478	0,28
500 Apidos Clo Xlix, Series 2024 49A, Class E, 144A, 9,068 %, fällig 24.10.2037 *	501	0,09	1.018 Labrador Aviation Finance Ltd 2016-1A, Series 2016 1A, Class A1, 144A, 4,300 %, fällig 15.01.2042	1.025	0,19
810 Apidos Loan Fund 2024-1 Ltd, Series 2024 1A, Class ER, 144A, 8,418 %, fällig 25.10.2038 *	816	0,15	1.064 Loanpal Solar Loan 2021-1 Ltd, Series 2021 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2048	692	0,13
1.160 Applebee's Funding LLC / IHOP Funding LLC, Series 2025 1A, Class A2, 144A, 6,720 %, fällig 07.06.2055	1.176	0,22	2.104 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.03.2048	1.260	0,24
1.780 Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2023 6A, Class D, 144A, 7,370 %, fällig 20.12.2029	1.839	0,35	947 Loanpal Solar Loan Ltd, Series 2020 3GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.12.2047	524	0,10
600 Ballyrock CLO 14 Ltd, Series 2020 14A, Class C1R, 144A, 6,668 %, fällig 20.07.2037 *	605	0,11	30 Long Beach Mortgage Loan Trust 2002-2, Series 2002 2, Class M2, 5,587 %, fällig 25.07.2032 *	30	0,01
500 Ballyrock CLO 14 Ltd, Series 2020 14A, Class DR, 144A, 9,518 %, fällig 20.07.2037 *	501	0,10	1.481 MAPS 2026-1 Trust, Series 2026 1A, Class B, 144A, 6,129 %, fällig 15.01.2051	1.514	0,29
468 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A2, 7,331 %, fällig 28.08.2047	417	0,08	900 Marble Point CLO XVII Ltd, Series 2020 1A, Class D1R, 144A, 7,318 %, fällig 20.07.2037 *	909	0,17
1.244 Bayview Financial Mortgage Pass-Through Trust 2007-B, Series 2007 B, Class 1A3, 7,719 %, fällig 28.08.2047	319	0,06	32 Mastr Specialized Loan Trust, Series 2006 2, Class A, 144A, 4,308 %, fällig 25.02.2036 *	31	0,01
22 Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2005-CL1, Series 2005 CL1, Class A1, 2,263 %, fällig 25.09.2034 *	23	–	1.360 MetroNet Infrastructure Issuer LLC, Series 2025 2A, Class C, 144A, 7,830 %, fällig 20.08.2055	1.406	0,27
1.500 Bellemeade Re 2025-1 Ltd, Series 2025 1, Class M2, 144A, 7,567 %, fällig 25.10.2035 *	1.551	0,30	2 Morgan Stanley ABS Capital I Inc Trust Series 2003-SD1, Series 2003 SD1, Class A1, 4,788 %, fällig 25.03.2033 *	2	–
1.223 Blackbird Capital Aircraft Lease Securitization Ltd 2016-1, Series 2016 1A, Class B, 144A, 5,682 %, fällig 16.12.2041	1.226	0,23	1.700 Mosaic Solar Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class CERT, 144A, 0,000 %, fällig 22.06.2043	667	0,13
2.249 Business Jet Securities 2024-1 LLC, Series 2024 1A, Class B, 144A, 6,924 %, fällig 15.05.2039	2.349	0,44	1.074 Mosaic Solar Loan Trust 2024-1, Series 2024 1A, Class B, 144A, 6,250 %, fällig 20.09.2049	940	0,18
1.230 Capital Four US CLO Ltd, Series 2025 4A, Class E, 144A, 9,888 %, fällig 18.10.2038 *	1.232	0,23	5.376 National Collegiate Student Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class B, 4,288 %, fällig 27.07.2037 *	4.405	0,83
1.250 Carval Clo X-C Ltd, Series 2024 2A, Class D2, 144A, 8,068 %, fällig 20.07.2037 *	1.263	0,24	3.200 National Collegiate Student Loan Trust 2006-4, Series 2006 4, Class B, 4,128 %, fällig 25.05.2032 *	1.814	0,34
1.410 CarVal CLO XI C Ltd, Series 2024 3A, Class E, 144A, 10,018 %, fällig 20.10.2037 *	1.429	0,27	5.975 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A5, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	717	0,14
1.218 Conesco Finance Corp, Series 1999 4, Class A8, 7,700 %, fällig 01.05.2031 *	315	0,06	6.128 National Collegiate V Commutation Trust, Series 2007 33A6, Class 10, 144A, 0,000 %, fällig 25.03.2038 *	736	0,14
2.707 Conesco Finance Corp, Series 1999 4, Class A9, 7,020 %, fällig 01.05.2031 *	648	0,12	790 Neuberger Berman Loan Advisers CO 56 Ltd, Series 2024 56A, Class E, 144A, 9,418 %, fällig 24.07.2037 *	799	0,15
5.526 Conesco Finance Securitizations Corp, Series 2000 3, Class A, 144A, 8,260 %, fällig 01.12.2030 *	875	0,17	1.340 NRM FNT1 Excess LLC, Series 2024 FNT1, Class A, 144A, 7,398 %, fällig 25.11.2031	1.372	0,26
649 Countrywide Asset-Backed Certificates, Series 2007 SD1, Class A1, 144A, 4,688 %, fällig 25.03.2047 *	500	0,09	985 Ocean Trails CLO XII Ltd, Series 2022 12A, Class ER, 144A, 11,168 %, fällig 20.07.2035 *	962	0,18
1 Credit-Based Asset Servicing and Securitization LLC, Series 2007 MX1, Class A4, 144A, 6,731 %, fällig 25.12.2036	1	–	1.350 Ocp Clo 2024-33 Ltd, Series 2024 33A, Class E, 144A, 9,668 %, fällig 20.07.2037 *	1.365	0,26
1.888 CWABS Asset-Backed Certificates Trust 2004-9, Series 2004 9, Class MF2, 5,572 %, fällig 25.11.2034 *	1.880	0,36	2.000 OHA Credit Funding 19 Ltd, Series 2024 19A, Class D2, 144A, 7,918 %, fällig 20.07.2037 *	2.020	0,38
1.027 CWHEQ Revolving Home Equity Loan Trust Series 2007-A, Series 2007 A, Class A, 3,894 %, fällig 15.04.2037 *	990	0,19	720 Peace Park CLO Ltd, Series 2021 1A, Class ER, 144A, 8,568 %, fällig 20.10.2038 *	683	0,13
1.231 Dividend Solar Loans 2018-1 LLC, Series 2018 1, Class D, 144A, 6,390 %, fällig 20.07.2038	1.001	0,19	1.570 Phantom Aviation, Series 2026 1A, Class B, 144A, 6,027 %, fällig 15.01.2051	1.590	0,30
2.172 Dividend Solar Loans 2018-2 LLC, Series 2018 2, Class D, 144A, 5,910 %, fällig 20.12.2038	1.667	0,31	2.000 Point Broadband Funding LLC, Series 2025 1A, Class C, 144A, 8,156 %, fällig 20.07.2055	2.076	0,39
1 DRB Prime Student Loan Trust 2017-A, Series 2017 A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 27.05.2042	1.679	0,32	2.577 Popular ABS Mortgage Pass-Through Trust 2005-2, Series 2005 2, Class M2, 6,217 %, fällig 25.04.2035	2.288	0,43
1.970 Driven Brands Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2, 144A, 6,372 %, fällig 20.10.2054	2.041	0,39	1.110 RR 18 Ltd, Series 2021 18A, Class DR, 144A, 8,572 %, fällig 15.07.2040 *	1.070	0,20
1.855 Driven Brands Funding LLC, Series 2025 1A, Class A2, 144A, 5,296 %, fällig 20.10.2055	1.875	0,35	404 SEB Funding LLC, Series 2021 1A, Class A2, 144A, 4,969 %, fällig 30.01.2052	404	0,08
910 Dryden 113 CLO Ltd, Series 2022 113A, Class D1R3, 144A, 6,672 %, fällig 15.10.2037 *	911	0,17	2.370 SEB Funding LLC, Series 2024 1A, Class A2, 144A, 7,386 %, fällig 30.04.2054	2.439	0,46
1.065 FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig 30.10.2053	1.133	0,21	1.862 Sesac Finance LLC, Series 2024 1, Class A2, 144A, 6,421 %, fällig 25.01.2054	1.910	0,36
6.012 Fremont Home Loan Trust 2006-B, Series 2006 B, Class 1A, 3,938 %, fällig 25.08.2036 *	2.476	0,47	1.433 SLAM 2025-1 Ltd, Series 2025 1A, Class A, 144A, 5,807 %, fällig 15.05.2050	1.484	0,28
2.414 GGAM Master Trust International Ltd, Series 2025 1A, Class A, 144A, 5,923 %, fällig 30.09.2060	2.475	0,47	2.347 SMB Private Education Loan Trust 2022-A, Series 2022 A, Class D, 144A, 4,750 %, fällig 16.11.2054	2.281	0,43
580 Golub Capital Partners CLO 74 B Ltd, Series 2024 74A, Class D1, 144A, 6,868 %, fällig 25.07.2037 *	584	0,11	1.540 SMB Private Education Loan Trust 2024-D, Series 2024 D, Class D, 144A, 7,510 %, fällig 15.07.2053	1.611	0,30
2.281 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2021-4, Series 2021 4GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.07.2048	827	0,16	1.679 Stonepeak 2021-1 ABS, Series 2021 1A, Class B, 144A, 3,821 %, fällig 28.02.2033	1.651	0,31
2.868 GoodLeap Sustainable Home Solutions Trust 2022-1, Series 2022 1GS, Class C, 144A, 3,500 %, fällig 20.01.2049	880	0,17	3.456 Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-9XS, Series 2005 9XS, Class M2, 4,763 %, fällig 25.06.2035 *	3.626	0,69
1.781 HERO Funding Trust 2016-1, Series 2016 1A, Class R, 144A, 0,000 %, fällig 20.09.2041	278	0,05	2.103 Sunnova Sol Issuer LLC, Series 2020 1A, Class B, 144A, 5,540 %, fällig 01.02.2055	1.794	0,34
3.310 Home Partners of America 2021-2 Trust, Series 2021 2, Class F, 144A, 3,799 %, fällig 17.12.2026	3.262	0,62	990 Trinitas CLO XXIX Ltd, Series 2024 29A, Class D1, 144A, 7,071 %, fällig 23.07.2037 *	996	0,19
1.770 Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 9,667 %, fällig 25.10.2033 *	1.910	0,36	489 WAVE 2019-1 LLC, Series 2019 1, Class A, 144A, 3,597 %, fällig 15.09.2044	480	0,09
3.100 Home Re 2026-1 Ltd, Series 2026 1, Class M1C, 144A, 6,267 %, fällig 25.01.2036 *	3.119	0,59	1.451 WAVE 2019-1 LLC, Series 2019 1, Class B, 144A, 4,581 %, fällig 15.09.2044	1.432	0,27
2.324 Horizon Aircraft Finance III Ltd, Series 2019 2, Class A, 144A, 3,425 %, fällig 15.11.2039	2.279	0,43	520 Wellesley Park CLO Ltd, Series 2025 1A, Class E, 144A, 8,507 %, fällig 24.01.2039 *	507	0,10
			2.392 Willis Engine Structured Trust VIII, Series 2025 A, Class B, 144A, 6,070 %, fällig 15.06.2050	2.454	0,46
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 126.214 \$)				107.890	20,40

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 69,83 % (28. Februar 2025: 74,99 %)							
5.919	280 Park Avenue 2017-280P Mortgage Trust, Series 2017 280P, Class F, 144A, 6,796 %, fällig 15.09.2034 *	5.794	1,10	4.127	CSMC 2017-RPL1 Trust, Series 2017 RPL1, Class B4, 144A, 2,983 %, fällig 25.07.2057 *	1.720	0,33
3.250	A10 2025-FL6 Issuer LLC, Series 2025 FL6, Class A, 144A, 5,145 %, fällig 15.05.2042 *	3.254	0,62	2.306	CSMC 2017-RPL3 Trust, Series 2017 RPL3, Class B4, 144A, 4,356 %, fällig 01.08.2057 *	2.221	0,42
801	Alternative Loan Trust 2005-80CB, Series 2005 80CB, Class 2A1, 6,000 %, fällig 25.02.2036	800	0,15	–	CSMC 2018-J1 Trust, Series 2018 J1, Class SA, 144A, 0,000 %, fällig 25.02.2048	–	–
878	Alternative Loan Trust 2007-23CB, Series 2007 23CB, Class A8, 13,247 %, fällig 25.09.2037 *	815	0,15	7.657	CSMC Mortgage-Backed Trust 2006-7, Series 2006 7, Class 11A2, 2,712 %, fällig 25.08.2036 *†	938	0,18
2.693	Angel Oak Mortgage Trust 2025-6, Series 2025 6, Class A3, 144A, 5,920 %, fällig 25.04.2070	2.724	0,52	6.132	CSMC Trust 2017-CHOP, Series 2017 CHOP, Class H, 144A, 11,044 %, fällig 15.07.2032 *	5.928	1,12
2.800	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2025-FL1 LLC, Series 2025 FL1, Class D, 144A, 6,960 %, fällig 20.01.2043 *	2.816	0,53	3.755	CSWF 2018-TOP, Series 2018 TOP, Class H, 144A, 7,319 %, fällig 15.08.2035 *	3.669	0,69
1.800	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 2025-FL1 LLC, Series 2025 FL1, Class E, 144A, 7,609 %, fällig 20.01.2043 *	1.803	0,34	3.000	DBWF Mortgage Trust, Series 2015 LCM, Class B, 144A, 3,421 %, fällig 10.06.2034 *	2.929	0,55
2.550	AREIT 2025-CRE11, Series 2025 CRE11, Class A, 144A, 5,210 %, fällig 25.07.2043 *	2.557	0,48	473	DSLA Mortgage Loan Trust 2004-AR4, Series 2004 AR4, Class 2A2B, 4,621 %, fällig 19.01.2045 *	329	0,06
3.700	Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM, Series 2017 ATRM, Class E, 144A, 7,007 %, fällig 15.12.2036 *	3.529	0,67	2.158	DSLA Mortgage Loan Trust 2005-AR5, Series 2005 AR5, Class 2A1B, 4,461 %, fällig 19.09.2045 *	1.884	0,36
4.122	Bank of America Merrill Lynch Commercial Mortgage Trust 2017-BNK3, Series 2017 BNK3, Class E, 144A, 4,495 %, fällig 15.02.2050 *	3.430	0,65	400	DSLA Mortgage Loan Trust 2007-AR1, Series 2007 AR1, Class 2A1B, 3,961 %, fällig 19.04.2047 *	419	0,08
4.415	BCAP LLC 2014-RR2, Series 2014 RR2, Class 10A2, 144A, 3,996 %, fällig 26.07.2046 *	3.852	0,73	2.600	Dwight 2025-FL1 Issuer LLC, Series 2025 FL1, Class A, 144A, 5,326 %, fällig 18.06.2042 *	2.609	0,49
643	BCAP LLC Trust 2007-AA3, Series 2007 AA3, Class 1A2, 4,328 %, fällig 25.04.2037 *	1.116	0,21	781	Dwight 2025-FL1 Issuer LLC, Series 2025 FL1, Class E, 144A, 8,602 %, fällig 18.06.2042 *	782	0,15
864	Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust 2004-AC6, Series 2004 AC6, Class A1, 5,750 %, fällig 25.11.2034	788	0,15	2.600	EFMT 2025-INV1, Series 2025 INV1, Class B1, 144A, 7,185 %, fällig 25.03.2070 *	2.643	0,50
4.100	BF 2019-NYT Mortgage Trust, Series 2019 NYT, Class D, 144A, 5,957 %, fällig 15.12.2035 *	3.964	0,75	1.396	EFMT 2025-NQM5, Series 2025 NQM5, Class B1, 144A, 6,716 %, fällig 25.11.2070 *	1.411	0,27
2.820	BF 2019-NYT Mortgage Trust, Series 2019 NYT, Class E, 144A, 6,457 %, fällig 15.12.2035 *	2.611	0,49	2.000	EFMT 2026-INV2, Series 2026 INV2, Class B2, 144A, 6,961 %, fällig 25.02.2071 *	1.982	0,37
3.500	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class M1, 144A, 6,819 %, fällig 25.02.2064	3.538	0,67	3.500	EFMT 2026-NQM1, Series 2026 NQM1, Class B1, 144A, 6,535 %, fällig 25.02.2071 *	3.522	0,67
1.610	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A3, 144A, 6,158 %, fällig 25.06.2064	1.626	0,31	3.323	Fannie Mae REMICS, Series 2020 45, Class AI, 4,000 %, fällig 25.07.2050	639	0,12
4.690	BRAVO Residential Funding Trust 2025-NQM7, Series 2025 NQM7, Class A3, 144A, 5,814 %, fällig 25.07.2065	4.736	0,90	3.879	Freddie Mac Mscr Trust Mn2, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 7,017 %, fällig 25.07.2041 *	3.890	0,74
2.953	BRAVO Residential Funding Trust 2026-NQM1, Series 2026 NQM1, Class A3, 144A, 5,205 %, fällig 25.12.2065	2.951	0,56	1.349	Freddie Mac REMICS 5408, Class PI, 6,500 %, fällig 25.03.2054	239	0,05
2.070	Bravo Residential Funding Trust Series 2025-NQM1, Series 2025 NQM1, Class A3, 144A, 5,908 %, fällig 25.12.2064	2.091	0,40	7.256	Freddie Mac REMICS 5523, Class IQ, 6,500 %, fällig 25.04.2055	1.149	0,22
2.540	BRAVO Residential Funding Trust Series 2025-NQM8, Series 2025 NQM8, Class A3, 144A, 5,589 %, fällig 25.06.2065	2.557	0,48	2.548	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2016-1, Series 2016 1, Class M2, 144A, 3,750 %, fällig 25.09.2055 *	2.398	0,45
4.000	BRES Commercial Mortgage Trust 2025-ATCAP, Series 2025 ATCAP, Class F, 144A, 8,848 %, fällig 15.11.2042 *	4.025	0,76	1.558	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-1, Series 2018 1, Class M, 4,750 %, fällig 25.05.2057 *	1.549	0,29
5.000	BWAY 2013-1515 Mortgage Trust, Series 2013 1515, Class F, 144A, 3,927 %, fällig 10.03.2033 *	4.293	0,81	11.215	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-2, Series 2018 2, Class BX, 2,900 %, fällig 25.11.2057 *	4.409	0,83
4.000	BX Commercial Mortgage Trust 2024-BIO2, Series 2024 BIO2, Class D, 144A, 7,713 %, fällig 13.08.2041 *	3.931	0,74	15.788	Freddie Mac Seasoned Credit Risk Transfer Trust Series 2018-3, Series 2018 3, Class BX, 144A, 2,201 %, fällig 25.08.2057 *	4.859	0,92
5.260	BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class D, 144A, 6,117 %, fällig 15.02.2042 *	5.296	1,00	6.035	Freddie Mac STACR Debt Notes 2017-HRP1, Series 2017 HRP1, Class B2D, 6,782 %, fällig 25.12.2042 *	5.758	1,09
2.620	BXMT 2026-FL6 Ltd, Series 2026 FL6, Class A, 144A, 5,150 %, fällig 19.08.2043 *	2.624	0,50	6.470	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-DNA1, Series 2020 DNA1, Class B2, 144A, 9,032 %, fällig 25.01.2050 *	7.259	1,37
2.600	CIP Commercial Mortgage Trust 2025-SBAY, Series 2025 SBAY, Class E, 144A, 7,410 %, fällig 15.10.2037 *	2.612	0,49	8.000	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA2, Series 2020 DNA2, Class B2, 144A, 8,582 %, fällig 25.02.2050 *	8.841	1,67
457	Citicorp Mortgage Securities Trust Series 2007-3, Series 2007 3, Class 1A4, 6,000 %, fällig 25.04.2037	445	0,08	1.640	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA2, Series 2021 DNA2, Class B2, 144A, 9,667 %, fällig 25.08.2033 *	2.052	0,39
2.600	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-GC29, Series 2015 GC29, Class C, 3,974 %, fällig 10.04.2048 *	2.376	0,45	530	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA5, Series 2021 DNA5, Class B2, 144A, 9,167 %, fällig 25.01.2034 *	645	0,12
48	Citigroup Commercial Mortgage Trust 2015-P1, Series 2015 P1, Class D, 144A, 3,225 %, fällig 15.09.2048	47	0,01	3.978	Freddie Mac STACR Securitized Participation Interests Trust 2018-SPI1, Series 2018 SPI1, Class B, 144A, 3,789 %, fällig 25.02.2048 *	2.971	0,56
749	Citigroup Mortgage Loan Trust 2008-3, Series 2008 3, Class A3, 144A, 6,100 %, fällig 25.04.2037	349	0,07	4.620	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA1, Series 2019 DNA1, Class B2, 144A, 14,532 %, fällig 25.01.2049 *	5.707	1,08
814	COLT 2024-2 Mortgage Loan Trust, Series 2024 2, Class A3, 144A, 6,429 %, fällig 25.04.2069	821	0,16	5.550	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA4, Series 2019 DNA4, Class B2, 144A, 10,032 %, fällig 25.10.2049 *	6.139	1,16
2.408	COLT 2025-6 Mortgage Loan Trust, Series 2025 6, Class A2, 144A, 5,783 %, fällig 25.08.2070	2.436	0,46	2.290	Freddie Mac STACR Trust 2019-FTR1, Series 2019 FTR1, Class B2, 144A, 12,132 %, fällig 25.01.2048 *	2.737	0,52
3.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B2, 144A, 9,167 %, fällig 25.12.2041 *	3.092	0,58	2.000	Freddie Mac STACR Trust 2019-FTR4, Series 2019 FTR4, Class B2, 144A, 8,782 %, fällig 25.11.2047 *	2.204	0,42
3.000	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R01, Series 2022 R01, Class 1B2, 144A, 9,667 %, fällig 25.12.2041 *	3.105	0,59	1.685	Freddie Mac Strips 390, Class C17, 4,500 %, fällig 15.11.2052	421	0,08
2.520	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R02, Series 2022 R02, Class 2B2, 144A, 11,317 %, fällig 25.01.2042 *	2.643	0,50	3.419	FRESB 2018-SB48 Mortgage Trust, Series 2018 SB48, Class B, 144A, 4,355 %, fällig 25.02.2038 *	2.079	0,39
3.170	CSAIL 2015-C3 Commercial Mortgage Trust, Series 2015 C3, Class C, 4,130 %, fällig 15.08.2048 *	2.948	0,56	678	Government National Mortgage Association, Series 2010 102, Class IO, 0,010 %, fällig 16.06.2052 *	–	–
207	CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates Series 2004-AR5, Series 2004 AR5, Class CB2, 5,334 %, fällig 25.06.2034 *	177	0,03	6.055	Government National Mortgage Association, Series 2012 114, Class IO, 0,635 %, fällig 16.01.2053 *	90	0,02
				568	Government National Mortgage Association, Series 2014 47, Class IA, 0,166 %, fällig 16.02.2048 *	2	–
				3.118	Government National Mortgage Association, Series 2014 50, Class IO, 0,587 %, fällig 16.09.2055 *	72	0,01
				12.914	Government National Mortgage Association, Series 2020 89, Class IA, 1,169 %, fällig 16.04.2062 *	1.054	0,20
				4.803	Government National Mortgage Association, Series 2022 202, Class Z, 3,000 %, fällig 16.10.2063 *	2.600	0,49

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)				5.000	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust 2016-C32, Series 2016 C32, Class D, 144A, 3,396 %, fällig 15.12.2049 *	4.408	0,83
2.859	Government National Mortgage Association, Series 2023 16, Class Z, 3,500 %, fällig 16.07.2063 *	1.910	0,36	3.742	Morgan Stanley Capital I Trust 2016-BNK2, Series 2016 BNK2, Class B, 3,485 %, fällig 15.11.2049	3.483	0,66
2.624	Government National Mortgage Association, Series 2023 184, Class HI, 7,000 %, fällig 20.12.2053	554	0,10	814	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2004-11AR, Series 2004 11AR, Class 1B1, 4,388 %, fällig 25.01.2035 *	759	0,14
12.056	Government National Mortgage Association, Series 2024 151, Class KS, 2,388 %, fällig 20.09.2054 *	1.056	0,20	3.155	Morgan Stanley Mortgage Loan Trust 2006-8AR, Series 2006 8AR, Class 1A3, 4,108 %, fällig 25.06.2036 *	578	0,11
5.749	Government National Mortgage Association, Series 2025 175, Class LS, 2,288 %, fällig 20.10.2055 *	584	0,11	292	Multifamily Trust 2016-1, Series 2016 1, Class B, 144A, 9,076 %, fällig 25.04.2046 *	287	0,05
6.614	Government National Mortgage Association, Series 2025 214, Class S, 2,938 %, fällig 20.12.2055 *	705	0,13	2.258	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class D, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	1.485	0,28
13.363	Government National Mortgage Association, Series 2026 5, Class SM, 2,038 %, fällig 20.12.2055 *	1.050	0,20	4.870	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2019-FAME, Series 2019 FAME, Class E, 144A, 4,398 %, fällig 15.08.2036 *	1.868	0,35
1.280	Greystone CRE Notes 2024-HC3, Series 2024 HC3, Class D, 144A, 8,992 %, fällig 15.03.2041 *	1.288	0,24	3.000	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 2022-JERI, Series 2022 JERI, Class G, 144A, 11,267 %, fällig 15.01.2039 *	2.016	0,38
4.000	Greystone CRE Notes 2025 HC-4 LLC, Series 2025 HC4, Class D, 144A, 7,600 %, fällig 15.10.2042 *	3.986	0,75	1.329	Neighborly Issuer 2023-1, Series 2023 1A, Class A2, 144A, 7,308 %, fällig 30.01.2053	1.346	0,25
2.751	GS Mortgage Securities Trust 2014-GC24, Series 2014 GC24, Class B, 4,498 %, fällig 10.09.2047 *	2.677	0,51	2.509	New Residential Mortgage Loan Trust 2016-4, Series 2016 4A, Class B5, 144A, 4,638 %, fällig 25.11.2056 *	2.446	0,46
1.348	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC28, Series 2015 GC28, Class D, 144A, 4,571 %, fällig 10.02.2048 *	1.296	0,24	4.259	New Residential Mortgage Loan Trust 2017-1, Series 2017 1A, Class B6, 144A, 5,288 %, fällig 25.02.2057 *	3.999	0,76
24	GS Mortgage Securities Trust 2015-GC32, Series 2015 GC32, Class D, 3,345 %, fällig 10.07.2048	24	–	3.939	New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class B6, 144A, 5,605 %, fällig 25.12.2057 *	3.578	0,68
4.756	GSR Mortgage Loan Trust 2006-1F, Series 2006 1F, Class 6A1, 4,188 %, fällig 25.02.2036 *	461	0,09	3.000	New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class B2, 144A, 4,051 %, fällig 27.11.2056 *	2.590	0,49
37	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-1, Series 2005 1, Class 2A1A, 4,321 %, fällig 19.03.2035 *	36	0,01	968	New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL1, Series 2024 RTL1, Class A2, 144A, 7,101 %, fällig 25.03.2039	971	0,18
332	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 2A1A, 4,221 %, fällig 19.05.2035 *	325	0,06	2.150	New Residential Mortgage Loan Trust 2024-RTL1, Series 2024 RTL1, Class M1, 144A, 9,298 %, fällig 25.03.2039 *	2.158	0,41
102	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-3, Series 2005 3, Class 2A1A, 4,261 %, fällig 19.06.2035 *	101	0,02	2.566	New Residential Mortgage Loan Trust 2025-NQM5, Series 2025 NQM5, Class A3, 144A, 5,464 %, fällig 25.08.2065	2.583	0,49
1.169	HarborView Mortgage Loan Trust 2005-8, Series 2005 8, Class 2A2, 5,415 %, fällig 19.09.2035 *	877	0,17	3.950	New Residential Mortgage Loan Trust 2026-NQM3, Series 2026 NQM3, Class A3, 144A, 5,189 %, fällig 25.02.2066	3.960	0,75
345	HarborView Mortgage Loan Trust 2006-10, Series 2006 10, Class 2A1A, 3,961 %, fällig 19.11.2036 *	311	0,06	2.143	NRM FHT1 Excess Owner LLC, Series 2025 FHT1, Class A, 144A, 6,545 %, fällig 25.03.2032	2.186	0,41
2.480	HOMES 2025-NQM1 Trust, Series 2025 NQM1, Class A3, 144A, 5,961 %, fällig 25.01.2070	2.503	0,47	2.750	NYMT Loan Trust Series 2024-BPL2, Series 2024 BPL2, Class A2, 144A, 6,811 %, fällig 25.05.2039	2.785	0,53
1.194	Impac CMB Trust Series 2005-3, Series 2005 3, Class A2, 4,388 %, fällig 25.08.2035 *	1.095	0,21	2.490	OBX 2024-NQM15 Trust, Series 2024 NQM15, Class A3, 144A, 5,722 %, fällig 25.10.2064	2.507	0,47
577	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR13, Series 2005 AR13, Class 1A1, 3,940 %, fällig 25.08.2035 *	249	0,05	3.573	OBX 2025-NQM10 Trust, Series 2025 NQM10, Class A3, 144A, 5,706 %, fällig 25.05.2065	3.606	0,68
411	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR2, Series 2005 AR2, Class 2A1B, 4,568 %, fällig 25.02.2035 *	292	0,06	3.952	OBX 2025-NQM8 Trust, Series 2025 NQM8, Class A3, 144A, 5,826 %, fällig 25.03.2065	3.994	0,76
1.719	IndyMac INDX Mortgage Loan Trust 2005-AR6, Series 2005 AR6, Class 2A2, 4,448 %, fällig 25.04.2035 *	1.365	0,26	3.256	Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class 1AC1, 4,388 %, fällig 25.04.2036 *	3.131	0,59
2.225	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class E, 144A, 7,714 %, fällig 15.10.2032 *	2.222	0,42	507	Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class M1, 4,343 %, fällig 25.04.2036 *	1.187	0,22
2.250	J.P. Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2017-FL11, Series 2017 FL11, Class F, 144A, 9,014 %, fällig 15.10.2032 *	1.958	0,37	1.900	PPF 2026-13 Ltd, Series 2026 13, Class A, 144A, 5,166 %, fällig 18.08.2043 *	1.908	0,36
3.433	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-FL7, Series 2015 FL7, Class D, 144A, 7,443 %, fällig 15.05.2028 *	3.012	0,57	1.306	PRPM 2025-RCF1 LLC, Series 2025 RCF1, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.02.2055	1.309	0,25
3.370	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2015-JP1, Series 2015 JP1, Class C, 4,752 %, fällig 15.01.2049 *	3.135	0,59	2.020	PRPM 2025-RCF3 LLC, Series 2025 RCF3, Class A2, 144A, 5,250 %, fällig 25.07.2055	2.051	0,39
1.800	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust 2018-WPT, Series 2018 WPT, Class GFL, 144A, 7,310 %, fällig 05.07.2033 *	246	0,05	503	RALI Series 2006-QA2 Trust, Series 2006 QA2, Class 1A1, 4,038 %, fällig 25.02.2036 *	327	0,06
7.526	JP Morgan Mortgage Trust 2018-4, Series 2018 4, Class AX1, 144A, 0,211 %, fällig 25.10.2048 *	48	0,01	586	Reperforming Loan REMIC Trust 2006-R2, Series 2006 R2, Class AF1, 144A, 4,208 %, fällig 25.07.2036 *	558	0,11
1.199	LHOME Mortgage Trust 2026-RTL1, Series 2026 RTL1, Class M1, 144A, 5,993 %, fällig 25.01.2041 *	1.207	0,23	3.020	Residential Asset Securitization Trust 2006-A7CB, Series 2006 A7CB, Class 1A3, 6,250 %, fällig 25.07.2036	2.261	0,43
700	LHOME Mortgage Trust 2026-RTL1, Series 2026 RTL1, Class M2, 144A, 7,694 %, fällig 25.01.2041 *	706	0,13	3.037	Santander Mortgage Asset Receivable Trust 2025-NQM2, Series 2025 NQM2, Class A3, 144A, 6,036 %, fällig 25.02.2065	3.072	0,58
1.322	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-6, Series 2004 6, Class B1, 5,528 %, fällig 25.07.2034 *	1.250	0,24	2.296	Santander Mortgage Asset Receivable Trust 2025-NQM3, Series 2025 NQM3, Class A2, 144A, 5,852 %, fällig 25.05.2065	2.323	0,44
940	MASTR Adjustable Rate Mortgages Trust 2004-8, Series 2004 8, Class B1, 6,019 %, fällig 25.09.2034 *	849	0,16	213	Structured Adjustable Rate Mortgage Loan Trust, Series 2004 2, Class 1A1, 6,699 %, fällig 25.03.2034 *	210	0,04
738	MASTR Reperforming Loan Trust 2005-2, Series 2005 2, Class 1A1F, 144A, 4,138 %, fällig 25.05.2035 *	347	0,07	35	Structured Asset Mortgage Investments II Trust 2006-AR6, Series 2006 AR6, Class 1A1, 4,148 %, fällig 25.07.2046 *	32	0,01
1.725	MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class E, 144A, 6,581 %, fällig 16.10.2036 *	1.701	0,32	2.475	Toorak Mortgage Trust 2024-RRTL2, Series 2024 RRTL2, Class B2, 144A, 9,191 %, fällig 25.09.2039 *	2.504	0,47
2.700	MF1 2022-FL8 Ltd, Series 2022 FL8, Class D, 144A, 6,317 %, fällig 19.02.2037 *	2.710	0,51	2.485	Towd Point Mortgage Trust 2016-4, Series 2016 4, Class B5, 144A, 3,943 %, fällig 25.07.2056 *	2.042	0,39
2.510	MF1 2024-FL16, Series 2024 FL16, Class A, 144A, 5,205 %, fällig 18.11.2039 *	2.519	0,48	3.612	Towd Point Mortgage Trust 2017-3, Series 2017 3, Class B5, 144A, 3,845 %, fällig 25.07.2057 *	2.703	0,51
1.395	MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class D, 144A, 6,405 %, fällig 18.02.2040 *	1.396	0,26				
1.270	MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class E, 144A, 7,154 %, fällig 18.02.2040 *	1.263	0,24				
3.360	MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042 *	3.375	0,64				
2.030	MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class D, 144A, 7,104 %, fällig 18.05.2042 *	2.036	0,39				
2.620	MF1 2026-FL21 LLC, Series 2026 FL21, Class A, 144A, 5,014 %, fällig 18.02.2041 *	2.622	0,50				

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
1.250 UBS Commercial Mortgage Trust 2018-C15, Series 2018 C15, Class C, 5,136 %, fällig 15.12.2051 *	1.210	0,23			
1.561 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class A3, 144A, 6,319 %, fällig 25.05.2068	1.561	0,30			
2.770 Verus Securitization Trust 2023-4, Series 2023 4, Class B1, 144A, 8,003 %, fällig 25.05.2068 *	2.777	0,53			
1.620 Verus Securitization Trust 2023-7, Series 2023 7, Class B1, 144A, 7,894 %, fällig 25.10.2068 *	1.639	0,31			
2.750 Verus Securitization Trust 2024-1, Series 2024 1, Class B1, 144A, 7,909 %, fällig 25.01.2069 *	2.803	0,53			
1.412 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class B1, 144A, 7,643 %, fällig 25.06.2069 *	1.435	0,27			
2.120 Verus Securitization Trust 2024-4, Series 2024 4, Class B2, 144A, 7,994 %, fällig 25.06.2069 *	2.151	0,41			
918 Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A3, 144A, 6,470 %, fällig 25.03.2069	928	0,18			
6.391 Verus Securitization Trust 2025-4, Series 2025 4, Class A3, 144A, 5,753 %, fällig 25.05.2070	6.452	1,22			
4.770 Verus Securitization Trust 2025-R1, Series 2025 R1, Class A3, 144A, 5,774 %, fällig 25.05.2065	4.829	0,91			
2.700 Verus Securitization Trust 2026-2, Series 2026 2, Class B1, 144A, 6,328 %, fällig 25.02.2071 *	2.714	0,51			
3.097 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Class B1, 4,703 %, fällig 25.08.2045 *	2.762	0,52			
753 WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR9 Trust, Series 2005 AR9, Class B1, 4,733 %, fällig 25.07.2045 *	707	0,13			
25 Waterfall Commercial Mortgage Trust 2015-SBC5, Series 2015 SBC5, Class B, 144A, 6,316 %, fällig 14.09.2022 *	25	–			
903 Wells Fargo Commercial Mortgage Trust 2015-C28, Series 2015 C28, Class D, 4,137 %, fällig 15.05.2048 *	870	0,16			
1.252 WFRBS Commercial Mortgage Trust 2014-C22, Series 2014 C22, Class D, 144A, 3,785 %, fällig 15.09.2057 *	492	0,09			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 386.065 \$)	369.234	69,83			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 1,45 % (28. Februar 2025: 1,27 %)					
USA – 1,45 % (28. Februar 2025: 1,27 %)					
1.200 Arbor Realty SR Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.12.2028	1.168	0,22			
2.970 Arbor Realty SR Inc, 144A, 7,875 %, fällig 15.07.2030	2.739	0,52			
980 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	948	0,18			
1.550 Full House Resorts Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.02.2028	1.349	0,25			
1.500 Petco Health & Wellness Co Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.02.2031	1.466	0,28			
	7.670	1,45			
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 8.001 \$)	7.670	1,45			
Schuldscheindarlehen – 2,38 % (28. Februar 2025: 3,05 %)					
30.000 American Dream, –%, fällig 30.06.2028 *†∞	67	0,01			
1.613 Freehand Hotel, –%, fällig 31.03.2026 *∞	1.425	0,27			
2.935 Freehand Hotel, –%, fällig 31.03.2026 *∞	2.592	0,49			
5.452 Freehand Hotel, –%, fällig 31.03.2026 *∞	4.816	0,91			
5.551 Sono Retail Loan, 7,053 %, fällig 06.04.2026 *∞	3.699	0,70			
Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 45.461 \$)	12.599	2,38			
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,95 % (28. Februar 2025: 1,07 %)					
20.876 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	20.876	3,95			
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 20.876 \$)	20.876	3,95			

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.HY, 5,000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	13.023	\$ 884
Bank of America Merrill Lynch	CDX.NA.IG, 1,000 % – Kauf	20. Dez. 2030	32.888	-642
Goldman Sachs	CMBX.NA.BB, 3,000 % – Verkauf	17. Dez. 2057	2.500	-202
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 884
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-844
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 40

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	1.322	Verkauf	USD	1.577	\$ -14
13. März 2026	BNY	Kauf	CHF	67	Verkauf	USD	87	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 7 \$)								\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								-14
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 7 \$)								\$ -14

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-20	\$ -2.277	\$ -18
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-210	-24.514	-250
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	27	2.974	12
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-152	-18.007	-128
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-57	-6.931	-108
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 12
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.088 \$)				-504
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.088 \$)				\$ -492

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungenbesicherte Wertpapiere – 1,91 % (28. Februar 2025: 1,40 %)					
2.591 AAET 2025-1, Series 2025 1A, Class A, 144A, 5,943 %, fällig 16.02.2050	2.672	0,21	23 Fannie Mae Pool 'AL3026', 3,500 %, fällig 01.12.2042	22	–
1.178 DB Master Finance LLC, Series 2021 1A, Class A23, 144A, 2,791 %, fällig 20.11.2051	1.073	0,09	877 Fannie Mae Pool 'AL4324', 6,500 %, fällig 01.05.2040	935	0,08
1.329 FOCUS Brands Funding, Series 2023 2, Class A2, 144A, 8,241 %, fällig 30.10.2053	1.414	0,11	88 Fannie Mae Pool 'AL4741', 4,500 %, fällig 01.01.2044	89	0,01
2.384 Home Partners of America 2021-3 Trust, Series 2021 3, Class A, 144A, 2,200 %, fällig 17.01.2041	2.261	0,18	3.466 Fannie Mae Pool 'AL7093', 4,000 %, fällig 01.05.2045	3.373	0,27
3.060 Kinetic ABS Issuer LLC, Series 2026 1A, Class A2, 144A, 5,219 %, fällig 25.02.2056	3.117	0,25	671 Fannie Mae Pool 'AL7877', 4,000 %, fällig 01.12.2045	664	0,05
1.778 Loanpal Solar Loan 2021-2 Ltd, Series 2021 2GS, Class B, 144A, 2,790 %, fällig 20.03.2048	1.217	0,10	572 Fannie Mae Pool 'AL8991', 3,000 %, fällig 01.08.2035	546	0,04
1.710 SBA Small Business Investment Cos, Series 2023 10A, Class 1, 5,168 %, fällig 10.03.2033	1.755	0,14	76 Fannie Mae Pool 'AL9546', 3,500 %, fällig 01.11.2046	74	0,01
1.953 SBA Small Business Investment Cos, Series 2023 10B, Class 1, 5,688 %, fällig 10.09.2033	2.063	0,17	75 Fannie Mae Pool 'AO4102', 4,000 %, fällig 01.06.2042	74	0,01
2.865 SLAM 2025-1 Ltd, Series 2025 1A, Class A, 144A, 5,807 %, fällig 15.05.2050	2.968	0,24	265 Fannie Mae Pool 'AP9766', 4,000 %, fällig 01.10.2042	264	0,02
1.360 SMB Private Education Loan Trust 2023-C, Series 2023 C, Class B, 144A, 6,360 %, fällig 15.11.2052	1.453	0,12	224 Fannie Mae Pool 'AQ7306', 3,000 %, fällig 01.01.2043	212	0,02
1.465 Store Master Funding I-VII XIV XIX XX, Series 2021 1A, Class A3, 144A, 2,860 %, fällig 20.06.2051	1.397	0,11	75 Fannie Mae Pool 'AR1198', 3,000 %, fällig 01.01.2043	71	0,01
2.400 Vantage Data Centers LLC, Series 2025 1A, Class A2, 144A, 5,132 %, fällig 15.08.2055	2.406	0,19	226 Fannie Mae Pool 'AR1202', 3,000 %, fällig 01.01.2043	213	0,02
			118 Fannie Mae Pool 'AR7399', 3,000 %, fällig 01.06.2043	111	0,01
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 24.145 \$)			269 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	252	0,02
	23.796	1,91	365 Fannie Mae Pool 'AS0462', 3,500 %, fällig 01.09.2033	361	0,03
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 99,31 % (28. Februar 2025: 98,39 %)			73 Fannie Mae Pool 'AS1281', 3,500 %, fällig 01.12.2033	71	0,01
2.900 AREIT 2025-CRE11, Series 2025 CRE11, Class A, 144A, 5,210 %, fällig 25.07.2043 *	2.908	0,23	2.433 Fannie Mae Pool 'AS4347', 4,000 %, fällig 01.01.2045	2.414	0,19
52.416 BANK 2017-BNK8, Series 2017 BNK8, Class XA, 0,703 %, fällig 15.11.2050 *	428	0,03	1.006 Fannie Mae Pool 'AS4363', 4,500 %, fällig 01.02.2045	1.020	0,08
2.400 BANK 2018-BNK10, Series 2018 BN10, Class A5, 3,688 %, fällig 15.02.2061	2.385	0,19	313 Fannie Mae Pool 'AS6340', 3,500 %, fällig 01.12.2045	302	0,02
2.210 Benchmark 2018-B1 Mortgage Trust, Series 2018 B1, Class A5, 3,666 %, fällig 15.01.2051 *	2.192	0,18	221 Fannie Mae Pool 'AS6541', 3,500 %, fällig 01.01.2046	213	0,02
3.050 BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class A, 144A, 5,067 %, fällig 15.02.2042 *	3.055	0,25	169 Fannie Mae Pool 'AS6562', 3,500 %, fällig 01.01.2046	162	0,01
52 BXMT 2020-FL2 Ltd, Series 2020 FL2, Class A, 144A, 4,929 %, fällig 15.02.2038 *	52	–	189 Fannie Mae Pool 'AS9453', 4,000 %, fällig 01.04.2047	187	0,02
2.440 BXMT 2026-FL6 Ltd, Series 2026 FL6, Class A, 144A, 5,150 %, fällig 19.08.2043 *	2.444	0,20	125 Fannie Mae Pool 'AS9760', 4,500 %, fällig 01.06.2047	126	0,01
1.000 Citigroup Commercial Mortgage Trust 2017-P8, Series 2017 P8, Class A3, 3,203 %, fällig 15.09.2050	990	0,08	122 Fannie Mae Pool 'AT2486', 3,500 %, fällig 01.06.2033	120	0,01
2.803 COLT 2025-11 Mortgage Loan Trust, Series 2025 11, Class A3, 144A, 5,409 %, fällig 25.11.2070	2.817	0,23	2.410 Fannie Mae Pool 'AT3070', 3,500 %, fällig 01.04.2043	2.338	0,19
1.550 CSMC 2021-NQMB, Series 2021 NQMB, Class A1, 144A, 2,841 %, fällig 25.10.2066 *	1.442	0,12	254 Fannie Mae Pool 'AU6735', 3,000 %, fällig 01.10.2043	238	0,02
850 Fannie Mae Interest Strip 406, Class 2, 4,000 %, fällig 25.02.2041	137	0,01	19 Fannie Mae Pool 'AV7116', 4,500 %, fällig 01.03.2044	20	–
406 Fannie Mae Interest Strip 407, Class C10, 5,000 %, fällig 25.01.2038	57	–	35 Fannie Mae Pool 'AV7681', 3,500 %, fällig 01.01.2034	34	–
281 Fannie Mae Interest Strip 409, Class C13, 3,500 %, fällig 25.11.2041	41	–	131 Fannie Mae Pool 'AV7683', 3,500 %, fällig 01.01.2034	128	0,01
1.619 Fannie Mae Interest Strip 417, Class C5, 3,500 %, fällig 25.02.2043	272	0,02	138 Fannie Mae Pool 'AV7694', 3,500 %, fällig 01.01.2034	135	0,01
3.833 Fannie Mae Interest Strip 418, Class C15, 3,500 %, fällig 25.08.2043	654	0,05	193 Fannie Mae Pool 'AV7696', 3,500 %, fällig 01.01.2034	190	0,02
1.415 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C21, 2,000 %, fällig 25.03.2050	177	0,01	1.535 Fannie Mae Pool 'AZ9645', 4,000 %, fällig 01.09.2035	1.536	0,12
13.294 Fannie Mae Interest Strip 427, Class C73, 3,000 %, fällig 25.12.2048	2.123	0,17	2.042 Fannie Mae Pool 'BF0144', 3,500 %, fällig 01.10.2056	1.918	0,15
1.370 Fannie Mae Interest Strip 429, Class C10, 1,500 %, fällig 25.04.2037	74	0,01	558 Fannie Mae Pool 'BF0145', 3,500 %, fällig 01.03.2057	523	0,04
3.329 Fannie Mae Interest Strip 435, Class C28, 3,500 %, fällig 25.09.2052	600	0,05	1.323 Fannie Mae Pool 'BF0161', 5,000 %, fällig 01.10.2046	1.371	0,11
11.371 Fannie Mae Interest Strip 440, Class C50, 4,500 %, fällig 25.10.2053	2.392	0,19	2.545 Fannie Mae Pool 'BF0162', 5,000 %, fällig 01.11.2045	2.637	0,21
7.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	5.801	0,47	710 Fannie Mae Pool 'BF0191', 4,000 %, fällig 01.06.2057	693	0,06
37.700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	32.671	2,62	883 Fannie Mae Pool 'BF0263', 3,500 %, fällig 01.05.2058	827	0,07
11.500 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	10.402	0,84	1.571 Fannie Mae Pool 'BF0301', 4,500 %, fällig 01.08.2058	1.557	0,13
18.700 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	17.625	1,42	554 Fannie Mae Pool 'BF0338', 4,500 %, fällig 01.01.2059	548	0,04
12.400 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 4,000 % ±	12.053	0,97	64 Fannie Mae Pool 'BJ0685', 4,000 %, fällig 01.04.2048	63	0,01
25.100 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	25.218	2,03	782 Fannie Mae Pool 'BJ2544', 3,000 %, fällig 01.12.2037	749	0,06
70 Fannie Mae Pool '745802', 6,000 %, fällig 01.07.2036	74	0,01	218 Fannie Mae Pool 'BJ2763', 4,500 %, fällig 01.05.2048	219	0,02
281 Fannie Mae Pool '836398', 5,847 %, fällig 01.10.2035 *	288	0,02	26 Fannie Mae Pool 'BK0751', 3,500 %, fällig 01.03.2048	25	–
3 Fannie Mae Pool '836852', 5,867 %, fällig 01.10.2035 *	3	–	604 Fannie Mae Pool 'BK4770', 4,500 %, fällig 01.08.2048	606	0,05
4 Fannie Mae Pool '843823', 5,867 %, fällig 01.11.2035 *	4	–	292 Fannie Mae Pool 'BM1660', 4,000 %, fällig 01.08.2047	289	0,02
64 Fannie Mae Pool '843997', 5,783 %, fällig 01.11.2035 *	65	0,01	784 Fannie Mae Pool 'BM3929', 3,500 %, fällig 01.07.2032	776	0,06
17 Fannie Mae Pool '865915', 5,997 %, fällig 01.03.2036 *	17	–	838 Fannie Mae Pool 'BM4696', 3,000 %, fällig 01.03.2047	789	0,06
400 Fannie Mae Pool '890604', 4,500 %, fällig 01.10.2044	407	0,03	138 Fannie Mae Pool 'BM4751', 3,500 %, fällig 01.03.2043	134	0,01
3 Fannie Mae Pool '995072', 5,500 %, fällig 01.08.2038	3	–	78 Fannie Mae Pool 'BM4781', 4,500 %, fällig 01.10.2048	79	0,01
791 Fannie Mae Pool 'AB3882', 4,500 %, fällig 01.11.2041	800	0,06	194 Fannie Mae Pool 'BM4897', 3,500 %, fällig 01.12.2046	188	0,02
283 Fannie Mae Pool 'AB5692', 4,000 %, fällig 01.06.2042	282	0,02	1.270 Fannie Mae Pool 'BM4951', 4,500 %, fällig 01.09.2048	1.283	0,10
133 Fannie Mae Pool 'AB9107', 3,500 %, fällig 01.04.2033	130	0,01	616 Fannie Mae Pool 'BM5073', 3,000 %, fällig 01.04.2048	573	0,05
24 Fannie Mae Pool 'AJ4713', 4,500 %, fällig 01.11.2041	24	–	91 Fannie Mae Pool 'BM5119', 4,500 %, fällig 01.12.2048	91	0,01
62 Fannie Mae Pool 'AL1051', 4,500 %, fällig 01.09.2041	63	0,01	559 Fannie Mae Pool 'BM6912', 2,500 %, fällig 01.01.2052	473	0,04
148 Fannie Mae Pool 'AL1470', 7,000 %, fällig 01.04.2037	158	0,01	81 Fannie Mae Pool 'BO2878', 3,000 %, fällig 01.11.2049	74	0,01
2.706 Fannie Mae Pool 'AL3024', 3,500 %, fällig 01.01.2043	2.609	0,21	11.616 Fannie Mae Pool 'BO5026', 3,000 %, fällig 01.12.2049	10.820	0,87
			124 Fannie Mae Pool 'BO8932', 3,000 %, fällig 01.01.2050	114	0,01
			629 Fannie Mae Pool 'BP2319', 3,000 %, fällig 01.02.2050	579	0,05
			517 Fannie Mae Pool 'BP3484', 2,500 %, fällig 01.06.2051	458	0,04
			817 Fannie Mae Pool 'BP6171', 3,500 %, fällig 01.04.2050	782	0,06
			3.056 Fannie Mae Pool 'BP7395', 1,500 %, fällig 01.10.2040	2.653	0,21
			470 Fannie Mae Pool 'BP8713', 3,000 %, fällig 01.08.2050	429	0,03
			242 Fannie Mae Pool 'BQ5876', 2,500 %, fällig 01.11.2050	215	0,02
			598 Fannie Mae Pool 'BR1001', 2,500 %, fällig 01.05.2051	531	0,04
			68 Fannie Mae Pool 'BR2303', 3,000 %, fällig 01.08.2051	63	0,01
			120 Fannie Mae Pool 'BR2641', 2,000 %, fällig 01.02.2051	101	0,01
			122 Fannie Mae Pool 'BR2643', 2,000 %, fällig 01.02.2051	103	0,01
			57 Fannie Mae Pool 'BR2644', 2,000 %, fällig 01.02.2051	49	–
			54 Fannie Mae Pool 'BR3256', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	–
			173 Fannie Mae Pool 'BR3257', 2,000 %, fällig 01.02.2051	145	0,01
			315 Fannie Mae Pool 'BR3286', 2,000 %, fällig 01.03.2051	267	0,02
			298 Fannie Mae Pool 'BR4722', 2,000 %, fällig 01.03.2051	252	0,02
			550 Fannie Mae Pool 'BR4756', 2,000 %, fällig 01.03.2051	464	0,04
			263 Fannie Mae Pool 'BR5487', 2,000 %, fällig 01.03.2051	222	0,02
			452 Fannie Mae Pool 'BR5587', 2,000 %, fällig 01.03.2051	383	0,03
			714 Fannie Mae Pool 'BR5633', 2,000 %, fällig 01.03.2051	604	0,05
			132 Fannie Mae Pool 'BR6515', 2,000 %, fällig 01.04.2051	111	0,01
			61 Fannie Mae Pool 'BR7744', 2,000 %, fällig 01.04.2051	51	–
			152 Fannie Mae Pool 'BR8276', 2,500 %, fällig 01.04.2051	135	0,01
			68 Fannie Mae Pool 'BR8478', 2,000 %, fällig 01.04.2051	57	–
			213 Fannie Mae Pool 'BR9104', 2,500 %, fällig 01.05.2051	188	0,02
			385 Fannie Mae Pool 'BT0846', 2,500 %, fällig 01.07.2051	342	0,03
			534 Fannie Mae Pool 'BT3244', 2,500 %, fällig 01.07.2051	473	0,04
			474 Fannie Mae Pool 'BT3270', 2,500 %, fällig 01.08.2051	420	0,03
			273 Fannie Mae Pool 'BT3290', 2,500 %, fällig 01.08.2051	242	0,02
			189 Fannie Mae Pool 'BT3303', 2,500 %, fällig 01.08.2051	168	0,01
			12.548 Fannie Mae Pool 'BU0971', 2,000 %, fällig 01.11.2051	10.586	0,85

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
679 Fannie Mae Pool 'BU2599', 2,500 %, fällig 01.01.2052	600	0,05	1.238 Fannie Mae Pool 'FS3411', 6,000 %, fällig 01.01.2053	1.278	0,10
2.736 Fannie Mae Pool 'BU2838', 2,500 %, fällig 01.11.2051	2.416	0,19	981 Fannie Mae Pool 'FS3589', 4,500 %, fällig 01.01.2050	992	0,08
63 Fannie Mae Pool 'BU5925', 3,000 %, fällig 01.12.2051	58	–	15.506 Fannie Mae Pool 'FS3756', 3,000 %, fällig 01.05.2051	14.293	1,15
2.672 Fannie Mae Pool 'BW5810', 5,000 %, fällig 01.08.2052	2.722	0,22	710 Fannie Mae Pool 'FS3977', 4,500 %, fällig 01.11.2052	711	0,06
640 Fannie Mae Pool 'BX7702', 6,500 %, fällig 01.02.2053	668	0,05	4.912 Fannie Mae Pool 'FS4269', 2,000 %, fällig 01.10.2051	4.157	0,33
4.000 Fannie Mae Pool 'BZ2295', 4,350 %, fällig 01.10.2034	4.064	0,33	3.733 Fannie Mae Pool 'FS4270', 2,000 %, fällig 01.03.2052	3.141	0,25
4.511 Fannie Mae Pool 'BZ5402', 4,360 %, fällig 01.12.2035	4.546	0,37	1.656 Fannie Mae Pool 'FS4570', 5,000 %, fällig 01.12.2047	1.706	0,14
105 Fannie Mae Pool 'CA0907', 3,500 %, fällig 01.12.2047	101	0,01	73 Fannie Mae Pool 'FS5708', 5,000 %, fällig 01.06.2053	75	0,01
994 Fannie Mae Pool 'CA0917', 3,500 %, fällig 01.12.2047	952	0,08	3.586 Fannie Mae Pool 'FS6000', 4,500 %, fällig 01.05.2050	3.596	0,29
875 Fannie Mae Pool 'CA1902', 4,500 %, fällig 01.06.2048	882	0,07	2.358 Fannie Mae Pool 'FS6691', 1,500 %, fällig 01.03.2042	2.028	0,16
731 Fannie Mae Pool 'CA6000', 3,000 %, fällig 01.06.2050	668	0,05	1.082 Fannie Mae Pool 'FS6779', 6,500 %, fällig 01.12.2053	1.128	0,09
388 Fannie Mae Pool 'CA6053', 3,000 %, fällig 01.06.2050	355	0,03	3.263 Fannie Mae Pool 'FS7283', 4,500 %, fällig 01.09.2053	3.282	0,26
2.946 Fannie Mae Pool 'CA7257', 2,500 %, fällig 01.10.2050	2.609	0,21	297 Fannie Mae Pool 'FS7294', 5,500 %, fällig 01.05.2044	311	0,03
3.839 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 01.11.2051	3.521	0,28	874 Fannie Mae Pool 'FS7940', 4,500 %, fällig 01.09.2053	878	0,07
2.328 Fannie Mae Pool 'CB2292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	2.142	0,17	2.229 Fannie Mae Pool 'FS8027', 2,500 %, fällig 01.03.2052	1.973	0,16
1.756 Fannie Mae Pool 'CB3044', 2,500 %, fällig 01.03.2052	1.551	0,12	2.573 Fannie Mae Pool 'FS8124', 3,000 %, fällig 01.06.2052	2.358	0,19
5.499 Fannie Mae Pool 'CB4898', 5,000 %, fällig 01.10.2052	5.594	0,45	10.616 Fannie Mae Pool 'FS8273', 1,500 %, fällig 01.02.2042	9.230	0,74
5.462 Fannie Mae Pool 'DC3239', 5,500 %, fällig 01.09.2054	5.593	0,45	22.079 Fannie Mae Pool 'FS8579', 2,000 %, fällig 01.08.2042	19.747	1,59
2.147 Fannie Mae Pool 'DC6402', 5,000 %, fällig 01.11.2054	2.164	0,17	943 Fannie Mae Pool 'FS8888', 6,500 %, fällig 01.06.2054	980	0,08
14.025 Fannie Mae Pool 'FA1423', 4,500 %, fällig 01.04.2054	13.929	1,12	2 Fannie Mae Pool 'MA0706', 4,500 %, fällig 01.04.2031	2	–
8.493 Fannie Mae Pool 'FA1727', 6,000 %, fällig 01.05.2055	8.724	0,70	5 Fannie Mae Pool 'MA0734', 4,500 %, fällig 01.05.2031	5	–
1.338 Fannie Mae Pool 'FM1002', 3,500 %, fällig 01.01.2048	1.286	0,10	3 Fannie Mae Pool 'MA0776', 4,500 %, fällig 01.06.2031	3	–
54 Fannie Mae Pool 'FM1159', 4,500 %, fällig 01.02.2048	54	–	63 Fannie Mae Pool 'MA0913', 4,500 %, fällig 01.11.2031	64	0,01
680 Fannie Mae Pool 'FM1349', 3,500 %, fällig 01.03.2047	657	0,05	78 Fannie Mae Pool 'MA0939', 4,500 %, fällig 01.12.2031	79	0,01
48 Fannie Mae Pool 'FM1458', 4,500 %, fällig 01.04.2049	49	–	19 Fannie Mae Pool 'MA0968', 4,500 %, fällig 01.12.2031	19	–
803 Fannie Mae Pool 'FM1637', 4,500 %, fällig 01.05.2049	809	0,07	135 Fannie Mae Pool 'MA1177', 3,500 %, fällig 01.09.2042	130	0,01
154 Fannie Mae Pool 'FM2173', 4,000 %, fällig 01.09.2048	152	0,01	8 Fannie Mae Pool 'MA1221', 4,500 %, fällig 01.09.2042	8	–
1.484 Fannie Mae Pool 'FM2256', 4,500 %, fällig 01.10.2044	1.501	0,12	1.053 Fannie Mae Pool 'MA1393', 4,000 %, fällig 01.03.2043	1.042	0,08
308 Fannie Mae Pool 'FM2745', 4,500 %, fällig 01.03.2050	308	0,02	217 Fannie Mae Pool 'MA1591', 4,500 %, fällig 01.09.2043	220	0,02
53 Fannie Mae Pool 'FM3083', 4,500 %, fällig 01.10.2049	53	–	172 Fannie Mae Pool 'MA1629', 4,500 %, fällig 01.10.2043	175	0,01
204 Fannie Mae Pool 'FM3158', 4,000 %, fällig 01.11.2048	201	0,02	110 Fannie Mae Pool 'MA1664', 4,500 %, fällig 01.11.2043	112	0,01
1.545 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 01.09.2048	1.524	0,12	152 Fannie Mae Pool 'MA1711', 4,500 %, fällig 01.12.2043	154	0,01
59 Fannie Mae Pool 'FM3542', 4,000 %, fällig 01.05.2049	58	–	289 Fannie Mae Pool 'MA2672', 3,000 %, fällig 01.07.2036	279	0,02
153 Fannie Mae Pool 'FM3830', 3,000 %, fällig 01.04.2050	141	0,01	283 Fannie Mae Pool 'MA2832', 3,000 %, fällig 01.12.2036	273	0,02
75 Fannie Mae Pool 'FM4532', 3,000 %, fällig 01.09.2050	68	0,01	183 Fannie Mae Pool 'MA4175', 1,500 %, fällig 01.11.2040	159	0,01
558 Fannie Mae Pool 'FM4577', 2,500 %, fällig 01.10.2050	492	0,04	519 Fannie Mae Pool 'MA4204', 2,000 %, fällig 01.12.2040	467	0,04
1.003 Fannie Mae Pool 'FM5423', 2,500 %, fällig 01.01.2051	888	0,07	371 Fannie Mae Pool 'MA4287', 2,000 %, fällig 01.03.2041	333	0,03
48 Fannie Mae Pool 'FM5743', 2,500 %, fällig 01.02.2051	43	–	406 Fannie Mae Pool 'MA4342', 1,500 %, fällig 01.05.2041	352	0,03
89 Fannie Mae Pool 'FM5904', 2,500 %, fällig 01.02.2051	79	0,01	597 Fannie Mae Pool 'MA4387', 2,000 %, fällig 01.07.2041	534	0,04
217 Fannie Mae Pool 'FM6117', 3,000 %, fällig 01.11.2048	202	0,02	388 Fannie Mae Pool 'MA4447', 2,500 %, fällig 01.10.2041	357	0,03
121 Fannie Mae Pool 'FM6460', 2,500 %, fällig 01.03.2051	107	0,01	1.097 Fannie Mae Pool 'MA4474', 2,000 %, fällig 01.11.2041	958	0,08
11.405 Fannie Mae Pool 'FM7382', 3,000 %, fällig 01.05.2051	10.437	0,84	1.231 Fannie Mae Pool 'MA4500', 1,500 %, fällig 01.12.2041	1.059	0,09
5.492 Fannie Mae Pool 'FM7518', 2,500 %, fällig 01.06.2051	4.861	0,39	1.755 Fannie Mae Pool 'MA4501', 2,000 %, fällig 01.12.2041	1.565	0,13
194 Fannie Mae Pool 'FM7529', 3,000 %, fällig 01.05.2051	179	0,01	426 Fannie Mae Pool 'MA4540', 2,000 %, fällig 01.02.2042	377	0,03
218 Fannie Mae Pool 'FM7675', 2,500 %, fällig 01.06.2051	193	0,02	17.096 Fannie Mae Pool 'MA4570', 2,000 %, fällig 01.03.2042	15.110	1,21
68 Fannie Mae Pool 'FM7676', 2,500 %, fällig 01.06.2051	61	–	3.492 Fannie Mae Pool 'MA4587', 2,500 %, fällig 01.04.2042	3.171	0,25
61 Fannie Mae Pool 'FM7694', 3,000 %, fällig 01.06.2051	56	–	529 Fannie Mae REMICS, Series 2010 2, Class AI, 5,500 %, fällig 25.02.2040	65	0,01
179 Fannie Mae Pool 'FM7727', 2,500 %, fällig 01.06.2051	160	0,01	383 Fannie Mae REMICS, Series 2012 9, Class PT, 11,686 %, fällig 25.07.2036 *	458	0,04
701 Fannie Mae Pool 'FM7869', 2,500 %, fällig 01.01.2051	620	0,05	516 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class BC, 6,500 %, fällig 25.07.2042	554	0,04
844 Fannie Mae Pool 'FM7900', 2,500 %, fällig 01.07.2051	748	0,06	2.132 Fannie Mae REMICS, Series 2013 9, Class CB, 5,500 %, fällig 25.04.2042	2.219	0,18
676 Fannie Mae Pool 'FM7910', 2,500 %, fällig 01.07.2051	601	0,05	3.470 Fannie Mae REMICS, Series 2016 48, Class IA, 4,500 %, fällig 25.06.2038	414	0,03
601 Fannie Mae Pool 'FM8025', 2,500 %, fällig 01.07.2051	534	0,04	2.281 Fannie Mae REMICS, Series 2017 74, Class PZ, 3,500 %, fällig 25.10.2047	1.977	0,16
234 Fannie Mae Pool 'FM8166', 3,000 %, fällig 01.06.2051	216	0,02	2.668 Fannie Mae REMICS, Series 2018 3, Class IO, 4,000 %, fällig 25.02.2048	527	0,04
1.161 Fannie Mae Pool 'FM8188', 3,000 %, fällig 01.03.2040	1.117	0,09	882 Fannie Mae REMICS, Series 2018 74, Class AB, 3,500 %, fällig 25.10.2048	843	0,07
2.143 Fannie Mae Pool 'FM8189', 3,000 %, fällig 01.08.2038	2.077	0,17	2.695 Fannie Mae REMICS, Series 2019 5, Class IO, 4,500 %, fällig 25.03.2049	498	0,04
999 Fannie Mae Pool 'FM8210', 3,000 %, fällig 01.04.2050	922	0,07	2.362 Fannie Mae REMICS, Series 2019 59, Class SH, 2,218 %, fällig 25.10.2049 *	311	0,02
1.190 Fannie Mae Pool 'FM8576', 3,000 %, fällig 01.02.2050	1.103	0,09	7.062 Fannie Mae REMICS, Series 2020 45, Class AI, 4,000 %, fällig 25.07.2050	1.359	0,11
2.534 Fannie Mae Pool 'FM8685', 3,000 %, fällig 01.09.2051	2.305	0,19	1.120 Fannie Mae REMICS, Series 2020 47, Class GZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	715	0,06
2.362 Fannie Mae Pool 'FM8786', 2,500 %, fällig 01.10.2051	2.093	0,17	530 Fannie Mae REMICS, Series 2020 57, Class TA, 2,000 %, fällig 25.04.2050	477	0,04
326 Fannie Mae Pool 'FM8864', 2,500 %, fällig 01.10.2051	287	0,02	822 Fannie Mae REMICS, Series 2020 61, Class NI, 3,500 %, fällig 25.09.2050	130	0,01
63 Fannie Mae Pool 'FM8977', 2,500 %, fällig 01.09.2051	56	–	2.205 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class AI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	373	0,03
378 Fannie Mae Pool 'FM9044', 3,000 %, fällig 01.10.2051	350	0,03	1.341 Fannie Mae REMICS, Series 2020 62, Class BI, 2,000 %, fällig 25.09.2050	155	0,01
2.053 Fannie Mae Pool 'FM9264', 2,000 %, fällig 01.10.2041	1.826	0,15	3.273 Fannie Mae REMICS, Series 2020 63, Class KI, 2,500 %, fällig 25.09.2050	184	0,01
1.408 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	1.293	0,10	1.576 Fannie Mae REMICS, Series 2020 71, Class IA, 2,000 %, fällig 25.03.2041	42	–
1.633 Fannie Mae Pool 'FM9362', 3,000 %, fällig 01.06.2038	1.590	0,13	516 Fannie Mae REMICS, Series 2020 74, Class EI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	88	0,01
125 Fannie Mae Pool 'FM9412', 2,500 %, fällig 01.11.2051	111	0,01	11.048 Fannie Mae REMICS, Series 2020 88, Class GI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.762	0,14
12.903 Fannie Mae Pool 'FM9434', 2,000 %, fällig 01.11.2051	10.922	0,88	936 Fannie Mae REMICS, Series 2020 89, Class DI, 2,500 %, fällig 25.12.2050	150	0,01
3.850 Fannie Mae Pool 'FM9507', 3,000 %, fällig 01.03.2037	3.768	0,30	7.391 Fannie Mae REMICS, Series 2020 91, Class IO, 2,500 %, fällig 25.12.2050	1.179	0,09
267 Fannie Mae Pool 'FM9867', 2,500 %, fällig 01.12.2051	237	0,02			
842 Fannie Mae Pool 'FS0028', 2,500 %, fällig 01.09.2051	744	0,06			
171 Fannie Mae Pool 'FS0041', 3,000 %, fällig 01.11.2050	158	0,01			
1.089 Fannie Mae Pool 'FS0316', 1,500 %, fällig 01.11.2041	937	0,08			
266 Fannie Mae Pool 'FS0408', 3,000 %, fällig 01.01.2052	246	0,02			
1.740 Fannie Mae Pool 'FS0520', 3,000 %, fällig 01.02.2052	1.596	0,13			
344 Fannie Mae Pool 'FS0534', 2,500 %, fällig 01.07.2051	305	0,02			
1.884 Fannie Mae Pool 'FS0551', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.670	0,13			
1.272 Fannie Mae Pool 'FS0582', 2,500 %, fällig 01.02.2052	1.124	0,09			
1.148 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	959	0,08			
634 Fannie Mae Pool 'FS0612', 2,000 %, fällig 01.02.2052	537	0,04			
420 Fannie Mae Pool 'FS1289', 3,000 %, fällig 01.03.2052	388	0,03			
264 Fannie Mae Pool 'FS1403', 3,000 %, fällig 01.01.2045	248	0,02			
339 Fannie Mae Pool 'FS1539', 3,000 %, fällig 01.11.2048	318	0,03			
630 Fannie Mae Pool 'FS1553', 2,500 %, fällig 01.11.2050	557	0,04			
1.030 Fannie Mae Pool 'FS1628', 2,500 %, fällig 01.04.2052	915	0,07			
5.429 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	5.204	0,42			
526 Fannie Mae Pool 'FS3009', 2,000 %, fällig 01.05.2042	467	0,04			
3.949 Fannie Mae Pool 'FS3191', 5,500 %, fällig 01.01.2052	4.064	0,33			

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
5.300 Fannie Mae REMICS, Series 2020 93, Class LI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	761	0,06	45 Freddie Mac Gold Pool 'U90316', 4,000 %, fällig 01.10.2042	45	–
2.529 Fannie Mae REMICS, Series 2020 97, Class AI, 2,000 %, fällig 25.01.2051	329	0,03	266 Freddie Mac Gold Pool 'U90378', 4,000 %, fällig 01.11.2042	265	0,02
9.002 Fannie Mae REMICS, Series 2021 1, Class IG, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.573	0,13	195 Freddie Mac Gold Pool 'U90436', 4,000 %, fällig 01.11.2042	195	0,02
8.831 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class IP, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.296	0,10	34 Freddie Mac Gold Pool 'U90608', 3,500 %, fällig 01.12.2042	33	–
1.043 Fannie Mae REMICS, Series 2021 3, Class NI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	159	0,01	49 Freddie Mac Gold Pool 'U90778', 3,500 %, fällig 01.01.2043	47	–
13.217 Fannie Mae REMICS, Series 2021 33, Class AI, 2,500 %, fällig 25.05.2047	1.714	0,14	61 Freddie Mac Gold Pool 'U90794', 3,500 %, fällig 01.01.2043	59	–
1.695 Fannie Mae REMICS, Series 2021 4, Class GI, 3,000 %, fällig 25.02.2051	291	0,02	92 Freddie Mac Gold Pool 'U90903', 3,500 %, fällig 01.02.2043	89	0,01
10.899 Fannie Mae REMICS, Series 2021 4, Class IO, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.800	0,14	115 Freddie Mac Gold Pool 'U91027', 3,500 %, fällig 01.02.2043	111	0,01
20.429 Fannie Mae REMICS, Series 2021 42, Class NI, 2,500 %, fällig 25.11.2048	2.766	0,22	2.950 Freddie Mac Gold Pool 'U99124', 3,500 %, fällig 01.03.2045	2.847	0,23
6.432 Fannie Mae REMICS, Series 2021 45, Class JI, 2,500 %, fällig 25.07.2051	931	0,07	1.460 Freddie Mac Gold Pool 'U99135', 4,000 %, fällig 01.02.2044	1.446	0,12
6.698 Fannie Mae REMICS, Series 2021 46, Class BI, 2,500 %, fällig 25.12.2048	932	0,07	53.807 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K065, Class X1, 0,649 %, fällig 25.04.2027 *	343	0,03
6.227 Fannie Mae REMICS, Series 2021 49, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	851	0,07	82.220 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K069, Class X1, 0,340 %, fällig 25.09.2027 *	381	0,03
17.702 Fannie Mae REMICS, Series 2021 52, Class CI, 2,500 %, fällig 25.12.2047	2.429	0,20	54.532 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K079, Class XAM, 0,079 %, fällig 25.06.2028 *	167	0,01
930 Fannie Mae REMICS, Series 2021 54, Class KI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	125	0,01	57.720 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K081, Class XAM, 0,073 %, fällig 25.08.2028 *	177	0,01
8.656 Fannie Mae REMICS, Series 2021 59, Class TI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	1.248	0,10	857 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K091, Class X1, 0,558 %, fällig 25.03.2029 *	14	–
1.392 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class KI, 2,500 %, fällig 25.04.2049	205	0,02	8.073 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K105, Class X1, 1,514 %, fällig 25.01.2030 *	404	0,03
7.398 Fannie Mae REMICS, Series 2021 61, Class PI, 2,500 %, fällig 25.09.2051	759	0,06	8.624 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K116, Class X1, 1,408 %, fällig 25.07.2030 *	433	0,03
2.425 Fannie Mae REMICS, Series 2021 62, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2047	343	0,03	964 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K121, Class X1, 1,013 %, fällig 25.10.2030 *	37	–
715 Fannie Mae REMICS, Series 2021 63, Class QI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	86	0,01	108.108 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K123, Class X1, 0,762 %, fällig 25.12.2030 *	3.239	0,26
5.941 Fannie Mae REMICS, Series 2021 69, Class IJ, 2,500 %, fällig 25.01.2049	836	0,07	3.556 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K124, Class X1, 0,714 %, fällig 25.12.2030 *	103	0,01
20.158 Fannie Mae REMICS, Series 2021 76, Class PI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	2.140	0,17	14.142 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K132, Class X1, 0,505 %, fällig 25.08.2031 *	337	0,03
25.161 Fannie Mae REMICS, Series 2021 8, Class DI, 3,500 %, fällig 25.03.2051	5.450	0,44	63.858 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K141, Class X1, 0,305 %, fällig 25.02.2032 *	1.099	0,09
2.339 Fannie Mae REMICS, Series 2021 89, Class AI, 2,500 %, fällig 25.04.2048	338	0,03	61.291 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K142, Class X1, 0,297 %, fällig 25.03.2032 *	1.013	0,08
10.639 Fannie Mae REMICS, Series 2021 91, Class IG, 2,500 %, fällig 25.01.2052	1.574	0,13	84.889 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K143, Class X1, 0,343 %, fällig 25.04.2055 *	1.648	0,13
11.953 Fannie Mae REMICS, Series 2022 29, Class KZ, 1,500 %, fällig 25.06.2042	9.334	0,75	22.645 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates K148, Class X1, 0,250 %, fällig 25.07.2032 *	373	0,03
523 Fannie Mae REMICS, Series 2022 57, Class BC, 4,000 %, fällig 25.09.2052	508	0,04	28.405 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates KG06, Class X1, 0,532 %, fällig 25.10.2031 *	697	0,06
195 Fannie Mae-Aces, Series 2016 M11, Class AL, 2,944 %, fällig 25.07.2039	182	0,01	6.694 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 154, Class X1, 0,353 %, fällig 25.01.2033 *	161	0,01
11.136 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M11, Class X1, 1,162 %, fällig 25.06.2029 *	271	0,02	57.887 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 155, Class X1, 0,264 %, fällig 25.04.2033 *	1.116	0,09
33.802 Fannie Mae-Aces, Series 2019 M14, Class X1, 0,550 %, fällig 25.06.2029 *	473	0,04	39.974 Freddie Mac Multifamily Structured Pass Through Certificates, Series K 160, Class X1, 0,209 %, fällig 25.08.2033 *	689	0,06
4.565 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M11, Class IO, 1,765 %, fällig 25.01.2029 *	180	0,01	3.984 Freddie Mac Non Gold Pool '841075', 3,281 %, fällig 01.01.2049 *	3.952	0,32
32.677 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M16, Class X1, 0,454 %, fällig 25.04.2032 *	546	0,04	1.769 Freddie Mac Non Gold Pool '841076', 3,008 %, fällig 01.11.2048 *	1.777	0,14
4.036 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M24, Class X1, 1,595 %, fällig 25.01.2037 *	322	0,03	282 Freddie Mac Non Gold Pool '841077', 5,156 %, fällig 01.11.2047 *	292	0,02
13.822 Fannie Mae-Aces, Series 2020 M31, Class X2, 1,212 %, fällig 25.12.2032 *	631	0,05	584 Freddie Mac Non Gold Pool '841081', 3,270 %, fällig 01.02.2050 *	598	0,05
729 Freddie Mac Gold Pool 'C91981', 3,000 %, fällig 01.02.2038	699	0,06	74 Freddie Mac Pool 'QA5770', 3,000 %, fällig 01.01.2050	69	0,01
3 Freddie Mac Gold Pool 'G06669', 6,500 %, fällig 01.09.2039	3	–	230 Freddie Mac Pool 'QA7238', 3,500 %, fällig 01.02.2050	219	0,02
743 Freddie Mac Gold Pool 'G08700', 4,500 %, fällig 01.03.2046	752	0,06	1.528 Freddie Mac Pool 'QA7256', 3,000 %, fällig 01.02.2050	1.401	0,11
82 Freddie Mac Gold Pool 'G16672', 3,000 %, fällig 01.03.2033	81	0,01	94 Freddie Mac Pool 'QA9685', 3,000 %, fällig 01.05.2050	87	0,01
830 Freddie Mac Gold Pool 'G60329', 5,500 %, fällig 01.06.2040	867	0,07	145 Freddie Mac Pool 'QA9686', 3,000 %, fällig 01.05.2050	135	0,01
2.681 Freddie Mac Gold Pool 'G60344', 4,000 %, fällig 01.12.2045	2.669	0,21	352 Freddie Mac Pool 'QB5092', 2,500 %, fällig 01.11.2050	312	0,03
3.838 Freddie Mac Gold Pool 'G61814', 3,500 %, fällig 01.09.2048	3.695	0,30	251 Freddie Mac Pool 'QB5093', 2,500 %, fällig 01.11.2050	223	0,02
6.578 Freddie Mac Gold Pool 'G67701', 3,000 %, fällig 01.10.2046	6.136	0,49	55 Freddie Mac Pool 'QB8602', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	–
174 Freddie Mac Gold Pool 'J39722', 3,000 %, fällig 01.10.2033	169	0,01	110 Freddie Mac Pool 'QB8604', 2,000 %, fällig 01.02.2051	93	0,01
133 Freddie Mac Gold Pool 'J39962', 3,000 %, fällig 01.12.2033	130	0,01	55 Freddie Mac Pool 'QB8773', 2,000 %, fällig 01.02.2051	46	–
129 Freddie Mac Gold Pool 'Q26702', 4,000 %, fällig 01.06.2044	129	0,01	59 Freddie Mac Pool 'QB9482', 2,000 %, fällig 01.03.2051	50	–
970 Freddie Mac Gold Pool 'U69040', 4,000 %, fällig 01.05.2045	966	0,08	130 Freddie Mac Pool 'QB9485', 2,000 %, fällig 01.03.2051	110	0,01
			68 Freddie Mac Pool 'QB9961', 2,000 %, fällig 01.03.2051	58	–
			51 Freddie Mac Pool 'QC0160', 2,000 %, fällig 01.03.2051	43	–
			65 Freddie Mac Pool 'QC0161', 2,000 %, fällig 01.03.2051	55	–
			63 Freddie Mac Pool 'QC0885', 2,000 %, fällig 01.04.2051	53	–
			127 Freddie Mac Pool 'QC2044', 2,500 %, fällig 01.05.2051	114	0,01
			416 Freddie Mac Pool 'QC3242', 3,000 %, fällig 01.06.2051	383	0,03
			319 Freddie Mac Pool 'QC3690', 2,500 %, fällig 01.07.2051	283	0,02
			348 Freddie Mac Pool 'QC4689', 2,500 %, fällig 01.08.2051	309	0,02
			357 Freddie Mac Pool 'QC4690', 2,500 %, fällig 01.08.2051	317	0,03

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
300 Freddie Mac Pool 'QC4818', 2,500 %, fällig 01.08.2051	266	0,02	62 Freddie Mac Pool 'ZN0614', 3,500 %, fällig 01.02.2043	60	–
385 Freddie Mac Pool 'QC4824', 2,500 %, fällig 01.08.2051	342	0,03	44 Freddie Mac Pool 'ZN2185', 4,500 %, fällig 01.12.2048	44	–
3.129 Freddie Mac Pool 'QC5830', 2,500 %, fällig 01.08.2051	2.766	0,22	4 Freddie Mac Pool 'ZS1530', 5,500 %, fällig 01.07.2037	4	–
1.535 Freddie Mac Pool 'QC7411', 2,500 %, fällig 01.09.2051	1.358	0,11	96 Freddie Mac Pool 'ZS3059', 5,500 %, fällig 01.12.2038	100	0,01
2.852 Freddie Mac Pool 'QC8573', 2,500 %, fällig 01.10.2051	2.520	0,20	82 Freddie Mac Pool 'ZS8673', 3,000 %, fällig 01.10.2032	80	0,01
726 Freddie Mac Pool 'QD1347', 2,500 %, fällig 01.11.2051	642	0,05	172 Freddie Mac Pool 'ZS9826', 3,000 %, fällig 01.10.2046	160	0,01
3.529 Freddie Mac Pool 'QD1596', 2,000 %, fällig 01.12.2051	2.989	0,24	29 Freddie Mac Pool 'ZT0474', 4,500 %, fällig 01.08.2048	29	–
75 Freddie Mac Pool 'QD1954', 3,000 %, fällig 01.11.2051	68	0,01	1.638 Freddie Mac Pool 'ZT1101', 3,000 %, fällig 01.01.2043	1.545	0,12
4.786 Freddie Mac Pool 'QD2419', 3,000 %, fällig 01.12.2051	4.370	0,35	567 Freddie Mac Pool 'ZT1107', 3,500 %, fällig 01.03.2043	547	0,04
200 Freddie Mac Pool 'QD4146', 2,500 %, fällig 01.01.2052	177	0,01	101 Freddie Mac Pool 'ZT1159', 3,500 %, fällig 01.02.2044	97	0,01
464 Freddie Mac Pool 'QD5620', 2,000 %, fällig 01.02.2052	390	0,03	102 Freddie Mac Pool 'ZT1257', 3,000 %, fällig 01.01.2046	97	0,01
80 Freddie Mac Pool 'QD5827', 2,000 %, fällig 01.02.2052	68	0,01	25 Freddie Mac Pool 'ZT1854', 4,500 %, fällig 01.03.2049	25	–
2.767 Freddie Mac Pool 'QD6079', 2,500 %, fällig 01.02.2052	2.448	0,20	78 Freddie Mac Pool 'ZT1970', 3,500 %, fällig 01.06.2049	78	0,01
223 Freddie Mac Pool 'QD6142', 2,500 %, fällig 01.02.2052	197	0,02	4.600 Freddie Mac REMICS 3810, Class WA, 5,220 %, fällig 15.06.2040 *	4.664	0,37
234 Freddie Mac Pool 'QD7365', 2,000 %, fällig 01.02.2052	198	0,02	1.617 Freddie Mac REMICS 4134, Class IM, 3,500 %, fällig 15.11.2042	259	0,02
869 Freddie Mac Pool 'QE8530', 5,500 %, fällig 01.08.2052	894	0,07	4.800 Freddie Mac REMICS 4377, Class UZ, 3,000 %, fällig 15.08.2044	4.081	0,33
1.832 Freddie Mac Pool 'QE8532', 5,500 %, fällig 01.08.2052	1.888	0,15	1.034 Freddie Mac REMICS 4597, Class DA, 3,000 %, fällig 15.12.2045	977	0,08
3.755 Freddie Mac Pool 'QE8537', 5,000 %, fällig 01.08.2052	3.825	0,31	905 Freddie Mac REMICS 4808, Class SB, 2,427 %, fällig 15.07.2048 *	128	0,01
68 Freddie Mac Pool 'QF0921', 5,000 %, fällig 01.09.2052	70	0,01	162 Freddie Mac REMICS 4813, Class CJ, 3,000 %, fällig 15.08.2048	146	0,01
1.545 Freddie Mac Pool 'QF3429', 5,500 %, fällig 01.11.2052	1.602	0,13	568 Freddie Mac REMICS 4870, Class ES, 2,227 %, fällig 15.04.2049 *	69	0,01
447 Freddie Mac Pool 'QF4924', 6,000 %, fällig 01.12.2052	460	0,04	1.201 Freddie Mac REMICS 4882, Class S, 2,277 %, fällig 15.05.2049 *	149	0,01
4.023 Freddie Mac Pool 'QF5465', 5,000 %, fällig 01.12.2052	4.057	0,33	1.912 Freddie Mac REMICS 4921, Class SN, 2,268 %, fällig 25.10.2049 *	285	0,02
787 Freddie Mac Pool 'QG2834', 5,000 %, fällig 01.04.2053	797	0,06	1.135 Freddie Mac REMICS 4936, Class YZ, 2,500 %, fällig 25.12.2049	1.001	0,08
3.013 Freddie Mac Pool 'QG5462', 6,000 %, fällig 01.06.2053	3.120	0,25	2.594 Freddie Mac REMICS 4980, Class KI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	606	0,05
5.167 Freddie Mac Pool 'QI6769', 5,500 %, fällig 01.05.2054	5.300	0,43	12.885 Freddie Mac REMICS 4981, Class YI, 4,500 %, fällig 25.06.2050	2.961	0,24
332 Freddie Mac Pool 'QX6746', 6,000 %, fällig 01.02.2055	343	0,03	3.024 Freddie Mac REMICS 4988, Class AZ, 2,000 %, fällig 25.07.2050	1.938	0,16
930 Freddie Mac Pool 'RA1293', 3,000 %, fällig 01.09.2049	860	0,07	1.783 Freddie Mac REMICS 4995, Class IQ, 2,500 %, fällig 25.07.2050	261	0,02
5.218 Freddie Mac Pool 'RA2194', 3,000 %, fällig 01.02.2050	4.836	0,39	7.725 Freddie Mac REMICS 4995, Class QI, 2,500 %, fällig 25.07.2050	1.152	0,09
321 Freddie Mac Pool 'RA3882', 2,000 %, fällig 01.11.2050	273	0,02	7.069 Freddie Mac REMICS 5027, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2050	1.188	0,10
4.447 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	3.939	0,32	2.522 Freddie Mac REMICS 5038, Class PJ, 0,750 %, fällig 25.10.2050	1.885	0,15
14.416 Freddie Mac Pool 'RA4142', 2,500 %, fällig 01.12.2050	12.796	1,03	172 Freddie Mac REMICS 5040, Class IB, 2,500 %, fällig 25.11.2050	23	–
1.439 Freddie Mac Pool 'RA4175', 2,500 %, fällig 01.12.2050	1.272	0,10	13.935 Freddie Mac REMICS 5050, Class IE, 2,000 %, fällig 25.12.2050	1.705	0,14
1.800 Freddie Mac Pool 'RA4526', 3,000 %, fällig 01.02.2051	1.659	0,13	1.874 Freddie Mac REMICS 5058, Class IL, 2,500 %, fällig 25.01.2051	266	0,02
460 Freddie Mac Pool 'RA4703', 2,000 %, fällig 01.02.2051	389	0,03	948 Freddie Mac REMICS 5059, Class IB, 2,500 %, fällig 25.01.2051	159	0,01
1.217 Freddie Mac Pool 'RA5117', 2,000 %, fällig 01.05.2051	1.027	0,08	1.641 Freddie Mac REMICS 5069, Class MI, 2,500 %, fällig 25.02.2051	244	0,02
353 Freddie Mac Pool 'RB0714', 2,000 %, fällig 01.12.2041	313	0,03	4.316 Freddie Mac REMICS 5070, Class NI, 2,000 %, fällig 25.02.2051	612	0,05
1.357 Freddie Mac Pool 'RB5110', 1,500 %, fällig 01.05.2041	1.177	0,09	7.696 Freddie Mac REMICS 5078, Class EI, 1,500 %, fällig 25.01.2051	810	0,07
6.611 Freddie Mac Pool 'RB5125', 2,000 %, fällig 01.09.2041	5.872	0,47	17.687 Freddie Mac REMICS 5085, Class IK, 2,500 %, fällig 25.03.2051	2.858	0,23
1.800 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	1.549	0,12	4.359 Freddie Mac REMICS 5085, Class NI, 2,000 %, fällig 25.03.2051	540	0,04
230 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	198	0,02	8.575 Freddie Mac REMICS 5092, Class IU, 2,500 %, fällig 25.02.2051	1.028	0,08
12.807 Freddie Mac Pool 'RB5138', 2,000 %, fällig 01.12.2041	11.312	0,91	7.272 Freddie Mac REMICS 5095, Class MI, 2,500 %, fällig 25.04.2051	1.201	0,10
434 Freddie Mac Pool 'RB5145', 2,000 %, fällig 01.02.2042	382	0,03	2.730 Freddie Mac REMICS 5113, Class NI, 2,500 %, fällig 25.06.2051	336	0,03
6.826 Freddie Mac Pool 'RB5154', 2,500 %, fällig 01.04.2042	6.274	0,50	1.883 Freddie Mac REMICS 5126, Class HC, 1,250 %, fällig 25.11.2036	1.707	0,14
1.781 Freddie Mac Pool 'RJ1350', 6,000 %, fällig 01.04.2054	1.837	0,15	9.619 Freddie Mac REMICS 5134, Class KI, 2,500 %, fällig 25.07.2048	1.276	0,10
8.296 Freddie Mac Pool 'SC0190', 2,500 %, fällig 01.09.2041	7.628	0,61	8.772 Freddie Mac REMICS 5135, Class DI, 2,500 %, fällig 25.05.2048	1.204	0,10
1.273 Freddie Mac Pool 'SC0319', 2,000 %, fällig 01.04.2042	1.124	0,09	16.158 Freddie Mac REMICS 5140, Class NI, 2,500 %, fällig 25.05.2049	2.342	0,19
2.545 Freddie Mac Pool 'SC0399', 2,000 %, fällig 01.05.2042	2.275	0,18	1.182 Freddie Mac REMICS 5149, Class NI, 2,500 %, fällig 25.01.2051	171	0,01
103 Freddie Mac Pool 'SD0247', 4,000 %, fällig 01.07.2047	102	0,01	42.904 Freddie Mac REMICS 5150, Class JI, 2,500 %, fällig 25.03.2051	4.610	0,37
165 Freddie Mac Pool 'SD0422', 4,500 %, fällig 01.07.2047	168	0,01	12.975 Freddie Mac REMICS 5154, Class QI, 2,500 %, fällig 25.10.2051	1.377	0,11
113 Freddie Mac Pool 'SD0573', 2,000 %, fällig 01.04.2051	96	0,01	7.895 Freddie Mac REMICS 5160, Class IU, 2,500 %, fällig 25.11.2050	1.064	0,09
266 Freddie Mac Pool 'SD0618', 3,000 %, fällig 01.02.2051	245	0,02	8.264 Freddie Mac REMICS 5162, Class DI, 2,500 %, fällig 25.11.2051	1.051	0,08
2.557 Freddie Mac Pool 'SD0630', 4,000 %, fällig 01.02.2050	2.522	0,20	7.700 Freddie Mac REMICS 5169, Class PW, 2,000 %, fällig 25.09.2051	5.648	0,45
708 Freddie Mac Pool 'SD0849', 2,500 %, fällig 01.01.2052	626	0,05			
301 Freddie Mac Pool 'SD0952', 3,000 %, fällig 01.04.2052	275	0,02			
1.393 Freddie Mac Pool 'SD1143', 4,500 %, fällig 01.09.2050	1.398	0,11			
1.357 Freddie Mac Pool 'SD1218', 4,000 %, fällig 01.07.2049	1.338	0,11			
2.669 Freddie Mac Pool 'SD1265', 4,500 %, fällig 01.06.2052	2.660	0,21			
3.272 Freddie Mac Pool 'SD1876', 5,500 %, fällig 01.11.2052	3.346	0,27			
7.330 Freddie Mac Pool 'SD2245', 5,500 %, fällig 01.12.2052	7.541	0,61			
5.120 Freddie Mac Pool 'SD2284', 6,000 %, fällig 01.12.2052	5.287	0,42			
634 Freddie Mac Pool 'SD2981', 6,500 %, fällig 01.05.2053	663	0,05			
310 Freddie Mac Pool 'SD2991', 2,500 %, fällig 01.09.2051	274	0,02			
11.274 Freddie Mac Pool 'SD3243', 3,000 %, fällig 01.12.2051	10.422	0,84			
3.403 Freddie Mac Pool 'SD3382', 5,000 %, fällig 01.06.2053	3.454	0,28			
142 Freddie Mac Pool 'SD3722', 5,000 %, fällig 01.05.2053	145	0,01			
2.108 Freddie Mac Pool 'SD3900', 5,500 %, fällig 01.08.2053	2.152	0,17			
223 Freddie Mac Pool 'SD5107', 6,000 %, fällig 01.07.2041	232	0,02			
318 Freddie Mac Pool 'SD5179', 5,000 %, fällig 01.12.2044	328	0,03			
11.770 Freddie Mac Pool 'SD5299', 6,000 %, fällig 01.04.2054	12.243	0,98			
2.379 Freddie Mac Pool 'SD5311', 5,500 %, fällig 01.04.2054	2.450	0,20			
3.528 Freddie Mac Pool 'SD5385', 6,000 %, fällig 01.02.2054	3.684	0,30			
479 Freddie Mac Pool 'SD7509', 3,000 %, fällig 01.11.2049	442	0,04			
3.523 Freddie Mac Pool 'SD7523', 2,500 %, fällig 01.08.2050	3.125	0,25			
167 Freddie Mac Pool 'SD7525', 2,500 %, fällig 01.10.2050	148	0,01			
2.975 Freddie Mac Pool 'SD7526', 2,500 %, fällig 01.10.2050	2.632	0,21			
526 Freddie Mac Pool 'SD7534', 2,500 %, fällig 01.02.2051	467	0,04			
18.535 Freddie Mac Pool 'SD7548', 2,500 %, fällig 01.11.2051	16.427	1,32			
9.016 Freddie Mac Pool 'SL0671', 5,500 %, fällig 01.03.2055	9.266	0,74			
7.100 Freddie Mac Pool 'VN4101', 4,600 %, fällig 01.03.2035	7.266	0,58			
725 Freddie Mac Pool 'ZA2343', 3,500 %, fällig 01.05.2034	716	0,06			
1.074 Freddie Mac Pool 'ZA2415', 3,000 %, fällig 01.06.2036	1.037	0,08			
197 Freddie Mac Pool 'ZA5297', 4,000 %, fällig 01.03.2048	195	0,02			
1.827 Freddie Mac Pool 'ZM1466', 3,500 %, fällig 01.07.2046	1.754	0,14			
3.273 Freddie Mac Pool 'ZM5659', 3,500 %, fällig 01.02.2048	3.126	0,25			
285 Freddie Mac Pool 'ZN0480', 3,500 %, fällig 01.10.2042	275	0,02			
639 Freddie Mac Pool 'ZN0538', 3,500 %, fällig 01.11.2042	616	0,05			
1.413 Freddie Mac Pool 'ZN0608', 3,500 %, fällig 01.02.2043	1.362	0,11			

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
5.101 Freddie Mac REMICS 5173, Class LI, 2,500 %, fällig 25.05.2050	781	0,06	1.157 Ginnie Mae II Pool '787228', 6,000 %, fällig 20.01.2054	1.201	0,10
1.336 Freddie Mac REMICS 5174, Class CJ, 2,000 %, fällig 25.01.2050	1.176	0,09	1.048 Ginnie Mae II Pool '787259', 2,000 %, fällig 20.02.2051	881	0,07
7.200 Freddie Mac REMICS 5178, Class CY, 2,000 %, fällig 25.01.2042	5.293	0,43	4.990 Ginnie Mae II Pool '787298', 5,000 %, fällig 20.01.2050	5.064	0,41
13.874 Freddie Mac REMICS 5179, Class GI, 2,500 %, fällig 25.01.2052	2.347	0,19	2.888 Ginnie Mae II Pool '787621', 3,000 %, fällig 20.03.2052	2.638	0,21
12.863 Freddie Mac REMICS 5180, Class IP, 3,000 %, fällig 25.01.2052	2.600	0,21	15.499 Ginnie Mae II Pool '788297', 2,500 %, fällig 20.01.2052	13.575	1,09
7.609 Freddie Mac REMICS 5190, Class GI, 2,500 %, fällig 25.10.2048	1.028	0,08	4.846 Ginnie Mae II Pool '788376', 2,500 %, fällig 20.08.2051	4.255	0,34
4.307 Freddie Mac REMICS 5202, Class NI, 3,000 %, fällig 25.08.2046	520	0,04	84 Ginnie Mae II Pool '892346', 6,673 %, fällig 20.08.2059 *	88	0,01
4.900 Freddie Mac REMICS 5209, Class EQ, 3,000 %, fällig 25.04.2052	3.877	0,31	53 Ginnie Mae II Pool '892614', 6,201 %, fällig 20.08.2060 *	55	–
971 Freddie Mac REMICS 5449, Class FQ, 5,167 %, fällig 25.09.2054 *	979	0,08	614 Ginnie Mae II Pool 'AV0243', 3,500 %, fällig 20.08.2046	585	0,05
999 Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 4,967 %, fällig 25.12.2054 *	1.008	0,08	822 Ginnie Mae II Pool 'AV8311', 3,500 %, fällig 20.08.2046	781	0,06
3.423 Freddie Mac REMICS 5523, Class IQ, 6,500 %, fällig 25.04.2055	542	0,04	863 Ginnie Mae II Pool 'AV8312', 3,500 %, fällig 20.08.2046	819	0,07
2.104 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA2, Series 2021 DNA2, Class M2, 144A, 5,967 %, fällig 25.08.2033 *	2.139	0,17	301 Ginnie Mae II Pool 'AZ3074', 4,000 %, fällig 20.02.2047	291	0,02
3.455 Freddie Mac Strips 390, Class C17, 4,500 %, fällig 15.11.2052	863	0,07	351 Ginnie Mae II Pool 'BC5293', 3,500 %, fällig 20.08.2047	333	0,03
185 Ginnie Mae I Pool '701947', 5,000 %, fällig 15.06.2039	192	0,02	2.363 Ginnie Mae II Pool 'BC5429', 3,500 %, fällig 20.10.2047	2.247	0,18
90 Ginnie Mae I Pool '733600', 5,000 %, fällig 15.04.2040	94	0,01	235 Ginnie Mae II Pool 'BD3554', 3,500 %, fällig 20.10.2047	223	0,02
187 Ginnie Mae I Pool '733627', 5,000 %, fällig 15.05.2040	193	0,02	1.219 Ginnie Mae II Pool 'BD3636', 3,500 %, fällig 20.10.2047	1.156	0,09
188 Ginnie Mae I Pool '781994', 5,500 %, fällig 15.11.2033	195	0,02	27 Ginnie Mae II Pool 'BG7951', 4,500 %, fällig 20.06.2048	27	–
222 Ginnie Mae I Pool '784571', 3,500 %, fällig 15.06.2048	214	0,02	411 Ginnie Mae II Pool 'BH1521', 4,500 %, fällig 20.07.2048	407	0,03
886 Ginnie Mae I Pool '787628', 4,500 %, fällig 15.01.2049	887	0,07	780 Ginnie Mae II Pool 'BH1870', 4,500 %, fällig 20.08.2048	784	0,06
96 Ginnie Mae I Pool 'AA5649', 3,000 %, fällig 15.09.2042	90	0,01	545 Ginnie Mae II Pool 'BM7534', 3,500 %, fällig 20.02.2050	513	0,04
116 Ginnie Mae I Pool 'AB2892', 3,000 %, fällig 15.09.2042	109	0,01	85 Ginnie Mae II Pool 'BM9734', 4,000 %, fällig 20.10.2049	83	0,01
33 Ginnie Mae I Pool 'AB9108', 3,000 %, fällig 15.10.2042	31	–	552 Ginnie Mae II Pool 'BR4627', 3,000 %, fällig 20.11.2049	508	0,04
180 Ginnie Mae I Pool 'AB9109', 3,000 %, fällig 15.10.2042	169	0,01	360 Ginnie Mae II Pool 'BS1728', 4,000 %, fällig 20.01.2050	343	0,03
155 Ginnie Mae I Pool 'AB9207', 3,000 %, fällig 15.11.2042	143	0,01	340 Ginnie Mae II Pool 'BS1742', 4,000 %, fällig 20.02.2050	331	0,03
1.143 Ginnie Mae I Pool 'BS8462', 3,500 %, fällig 15.06.2050	1.099	0,09	58 Ginnie Mae II Pool 'BS8546', 2,500 %, fällig 20.12.2050	50	–
5 Ginnie Mae II Pool '4040', 6,500 %, fällig 20.10.2037	5	–	393 Ginnie Mae II Pool 'BT1888', 2,500 %, fällig 20.12.2050	344	0,03
7 Ginnie Mae II Pool '4170', 6,000 %, fällig 20.06.2038	7	–	734 Ginnie Mae II Pool 'BT9472', 4,000 %, fällig 20.05.2050	707	0,06
478 Ginnie Mae II Pool '4245', 6,000 %, fällig 20.09.2038	516	0,04	1.747 Ginnie Mae II Pool 'BU3196', 4,000 %, fällig 20.05.2050	1.683	0,14
68 Ginnie Mae II Pool '4602', 6,000 %, fällig 20.12.2039	72	0,01	517 Ginnie Mae II Pool 'BW7380', 4,500 %, fällig 20.07.2050	509	0,04
83 Ginnie Mae II Pool '4617', 4,500 %, fällig 20.01.2040	85	0,01	780 Ginnie Mae II Pool 'BW7384', 4,000 %, fällig 20.08.2050	754	0,06
44 Ginnie Mae II Pool '4696', 4,500 %, fällig 20.05.2040	44	–	1.116 Ginnie Mae II Pool 'BX2423', 3,000 %, fällig 20.10.2050	1.012	0,08
25 Ginnie Mae II Pool '4747', 5,000 %, fällig 20.07.2040	26	–	72 Ginnie Mae II Pool 'CK9592', 4,000 %, fällig 20.06.2052	70	0,01
30 Ginnie Mae II Pool '4772', 5,000 %, fällig 20.08.2040	30	–	59 Ginnie Mae II Pool 'CL5523', 3,000 %, fällig 20.04.2052	53	–
2 Ginnie Mae II Pool '4774', 6,000 %, fällig 20.08.2040	2	–	391 Ginnie Mae II Pool 'CW6992', 6,000 %, fällig 20.09.2053	407	0,03
60 Ginnie Mae II Pool '4802', 5,000 %, fällig 20.09.2040	62	–	120 Ginnie Mae II Pool 'MA3597', 3,500 %, fällig 20.04.2046	115	0,01
24 Ginnie Mae II Pool '4855', 5,000 %, fällig 20.11.2040	25	–	65 Ginnie Mae II Pool 'MA3663', 3,500 %, fällig 20.05.2046	63	0,01
10 Ginnie Mae II Pool '4923', 4,500 %, fällig 20.01.2041	10	–	112 Ginnie Mae II Pool 'MA3736', 3,500 %, fällig 20.06.2046	108	0,01
5 Ginnie Mae II Pool '4928', 6,000 %, fällig 20.01.2041	5	–	68 Ginnie Mae II Pool 'MA3803', 3,500 %, fällig 20.07.2046	65	0,01
322 Ginnie Mae II Pool '4978', 4,500 %, fällig 20.03.2041	327	0,03	4.139 Ginnie Mae II Pool 'MA4003', 3,000 %, fällig 20.10.2046	3.856	0,31
711 Ginnie Mae II Pool '783050', 5,000 %, fällig 20.07.2040	727	0,06	588 Ginnie Mae II Pool 'MA4261', 3,000 %, fällig 20.02.2047	546	0,04
519 Ginnie Mae II Pool '783298', 4,500 %, fällig 20.04.2041	527	0,04	285 Ginnie Mae II Pool 'MA4511', 4,000 %, fällig 20.06.2047	279	0,02
51 Ginnie Mae II Pool '784106', 3,500 %, fällig 20.01.2046	49	–	1.644 Ginnie Mae II Pool 'MA4586', 3,500 %, fällig 20.07.2047	1.581	0,13
1.466 Ginnie Mae II Pool '784577', 4,000 %, fällig 20.07.2047	1.413	0,11	59 Ginnie Mae II Pool 'MA4587', 4,000 %, fällig 20.07.2047	58	–
52 Ginnie Mae II Pool '784905', 3,000 %, fällig 20.01.2050	47	–	85 Ginnie Mae II Pool 'MA4654', 4,500 %, fällig 20.08.2047	86	0,01
188 Ginnie Mae II Pool '785218', 2,000 %, fällig 20.12.2050	158	0,01	6.363 Ginnie Mae II Pool 'MA4961', 3,000 %, fällig 20.01.2048	5.915	0,48
162 Ginnie Mae II Pool '785220', 2,000 %, fällig 20.12.2050	137	0,01	2.324 Ginnie Mae II Pool 'MA5018', 3,000 %, fällig 20.02.2048	2.158	0,17
428 Ginnie Mae II Pool '785360', 2,000 %, fällig 20.03.2051	357	0,03	707 Ginnie Mae II Pool 'MA5076', 3,000 %, fällig 20.03.2048	656	0,05
126 Ginnie Mae II Pool '785532', 3,000 %, fällig 20.06.2051	114	0,01	2.361 Ginnie Mae II Pool 'MA5135', 3,000 %, fällig 20.04.2048	2.187	0,18
68 Ginnie Mae II Pool '785565', 2,500 %, fällig 20.06.2051	60	–	128 Ginnie Mae II Pool 'MA5138', 4,500 %, fällig 20.04.2048	129	0,01
458 Ginnie Mae II Pool '785568', 2,500 %, fällig 20.08.2051	403	0,03	95 Ginnie Mae II Pool 'MA5193', 4,500 %, fällig 20.05.2048	95	0,01
390 Ginnie Mae II Pool '785663', 2,500 %, fällig 20.10.2051	343	0,03	72 Ginnie Mae II Pool 'MA5194', 5,000 %, fällig 20.05.2048	73	0,01
407 Ginnie Mae II Pool '785667', 2,500 %, fällig 20.10.2051	357	0,03	13 Ginnie Mae II Pool 'MA5265', 4,500 %, fällig 20.06.2048	13	–
270 Ginnie Mae II Pool '785762', 2,500 %, fällig 20.11.2051	237	0,02	99 Ginnie Mae II Pool 'MA5331', 4,500 %, fällig 20.07.2048	100	0,01
276 Ginnie Mae II Pool '785789', 2,500 %, fällig 20.12.2051	243	0,02	1.343 Ginnie Mae II Pool 'MA5399', 4,500 %, fällig 20.08.2048	1.350	0,11
551 Ginnie Mae II Pool '785821', 2,500 %, fällig 20.12.2051	485	0,04	30 Ginnie Mae II Pool 'MA5467', 4,500 %, fällig 20.09.2048	30	–
7.096 Ginnie Mae II Pool '785944', 3,000 %, fällig 20.02.2052	6.469	0,52	173 Ginnie Mae II Pool 'MA5597', 5,000 %, fällig 20.11.2048	177	0,01
1.880 Ginnie Mae II Pool '786077', 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.715	0,14	46 Ginnie Mae II Pool 'MA5652', 4,500 %, fällig 20.12.2048	47	–
2.226 Ginnie Mae II Pool '786082', 3,000 %, fällig 20.11.2051	2.021	0,16	150 Ginnie Mae II Pool 'MA5711', 4,500 %, fällig 20.01.2049	151	0,01
202 Ginnie Mae II Pool '786095', 3,000 %, fällig 20.04.2052	185	0,01	145 Ginnie Mae II Pool 'MA5713', 5,500 %, fällig 20.01.2049	150	0,01
1.347 Ginnie Mae II Pool '786107', 3,000 %, fällig 20.03.2052	1.225	0,10	72 Ginnie Mae II Pool 'MA5764', 4,500 %, fällig 20.02.2049	72	0,01
1.158 Ginnie Mae II Pool '786108', 3,500 %, fällig 20.03.2052	1.071	0,09	1.732 Ginnie Mae II Pool 'MA5766', 5,500 %, fällig 20.02.2049	1.786	0,14
291 Ginnie Mae II Pool '786134', 3,000 %, fällig 20.04.2052	266	0,02	95 Ginnie Mae II Pool 'MA5818', 4,500 %, fällig 20.03.2049	96	0,01
145 Ginnie Mae II Pool '786150', 3,000 %, fällig 20.03.2052	132	0,01	359 Ginnie Mae II Pool 'MA5820', 5,500 %, fällig 20.03.2049	370	0,03
214 Ginnie Mae II Pool '786335', 4,500 %, fällig 20.09.2052	213	0,02	9 Ginnie Mae II Pool 'MA5877', 4,500 %, fällig 20.04.2049	9	–
446 Ginnie Mae II Pool '786340', 5,000 %, fällig 20.09.2052	451	0,04	347 Ginnie Mae II Pool 'MA5879', 5,500 %, fällig 20.04.2049	358	0,03
6.913 Ginnie Mae II Pool '786348', 4,500 %, fällig 20.08.2052	6.860	0,55	247 Ginnie Mae II Pool 'MA5934', 5,500 %, fällig 20.05.2049	255	0,02
5.397 Ginnie Mae II Pool '786374', 5,000 %, fällig 20.09.2052	5.440	0,44	2.579 Ginnie Mae II Pool 'MA5989', 5,500 %, fällig 20.06.2049	2.661	0,21
1.824 Ginnie Mae II Pool '786474', 5,000 %, fällig 20.01.2053	1.846	0,15	160 Ginnie Mae II Pool 'MA6217', 2,500 %, fällig 20.10.2049	143	0,01
265 Ginnie Mae II Pool '786583', 3,000 %, fällig 20.03.2052	240	0,02	87 Ginnie Mae II Pool 'MA6412', 4,500 %, fällig 20.01.2050	88	0,01
339 Ginnie Mae II Pool '786656', 5,000 %, fällig 20.04.2053	342	0,03	62 Ginnie Mae II Pool 'MA6542', 3,500 %, fällig 20.03.2050	59	–
151 Ginnie Mae II Pool '786843', 3,000 %, fällig 20.03.2052	138	0,01	90 Ginnie Mae II Pool 'MA6602', 4,500 %, fällig 20.04.2050	90	0,01
1.082 Ginnie Mae II Pool '786916', 5,500 %, fällig 20.08.2053	1.109	0,09	1.575 Ginnie Mae II Pool 'MA6657', 3,500 %, fällig 20.05.2050	1.504	0,12
1.352 Ginnie Mae II Pool '786963', 6,000 %, fällig 20.09.2053	1.400	0,11	153 Ginnie Mae II Pool 'MA6818', 2,000 %, fällig 20.08.2050	130	0,01
1.882 Ginnie Mae II Pool '787058', 5,000 %, fällig 20.08.2053	1.902	0,15	1.413 Ginnie Mae II Pool 'MA6869', 4,500 %, fällig 20.09.2050	1.424	0,11
			11.646 Ginnie Mae II Pool 'MA6930', 2,000 %, fällig 20.10.2050	9.887	0,79
			3.035 Ginnie Mae II Pool 'MA6931', 2,500 %, fällig 20.10.2050	2.684	0,22
			1.768 Ginnie Mae II Pool 'MA6935', 4,500 %, fällig 20.10.2050	1.782	0,14
			2.972 Ginnie Mae II Pool 'MA6994', 2,000 %, fällig 20.11.2050	2.521	0,20
			11.103 Ginnie Mae II Pool 'MA7312', 2,500 %, fällig 20.04.2051	9.812	0,79
			1.934 Ginnie Mae II Pool 'MA7316', 4,500 %, fällig 20.04.2051	1.951	0,16
			198 Ginnie Mae II Pool 'MA7471', 2,000 %, fällig 20.07.2051	168	0,01
			1.923 Ginnie Mae II Pool 'MA7472', 2,500 %, fällig 20.07.2051	1.699	0,14
			133 Ginnie Mae II Pool 'MA7533', 2,000 %, fällig 20.08.2051	113	0,01
			709 Ginnie Mae II Pool 'MA7595', 5,500 %, fällig 20.08.2051	737	0,06
			5.891 Ginnie Mae II Pool 'MA7648', 2,000 %, fällig 20.10.2051	4.996	0,40
			2.596 Ginnie Mae II Pool 'MA7990', 4,000 %, fällig 20.04.2052	2.521	0,20
			3.597 Ginnie Mae II Pool 'MA8044', 3,500 %, fällig 20.05.2052	3.420	0,27

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)					
888 Ginnie Mae II Pool 'MA8100', 4,000 %, fällig 20.06.2052	862	0,07	3.447 Government National Mortgage Association, Series 2020 191, Class IX, 2,500 %, fällig 20.12.2050	601	0,05
92 Ginnie Mae II Pool 'MA8263', 2,000 %, fällig 20.09.2052	78	0,01	24.551 Government National Mortgage Association, Series 2020 29, Class II, 0,932 %, fällig 16.01.2060 *	1.318	0,11
1.367 Ginnie Mae II Pool 'MA8269', 5,000 %, fällig 20.09.2052	1.381	0,11	18.996 Government National Mortgage Association, Series 2020 38, Class IO, 0,820 %, fällig 16.04.2062 *	1.122	0,09
434 Ginnie Mae II Pool 'MA8422', 2,000 %, fällig 20.11.2052	369	0,03	385 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class MI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	71	0,01
2.582 Ginnie Mae II Pool 'MA8429', 5,500 %, fällig 20.11.2052	2.641	0,21	1.082 Government National Mortgage Association, Series 2020 47, Class NI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	203	0,02
1.824 Ginnie Mae II Pool 'MA8484', 2,000 %, fällig 20.12.2052	1.547	0,12	714 Government National Mortgage Association, Series 2020 61, Class CI, 4,000 %, fällig 20.03.2050	131	0,01
8.175 Ginnie Mae II Pool 'MA8488', 4,000 %, fällig 20.12.2052	7.937	0,64	666 Government National Mortgage Association, Series 2020 85, Class CI, 3,500 %, fällig 20.04.2050	121	0,01
1.631 Ginnie Mae II Pool 'MA8794', 2,000 %, fällig 20.03.2053	1.385	0,11	5.332 Government National Mortgage Association, Series 2020 H04, Class GF, 4,447 %, fällig 20.02.2070 *	5.344	0,43
80 Ginnie Mae II Pool 'MA8798', 4,000 %, fällig 20.04.2053	78	0,01	8.780 Government National Mortgage Association, Series 2020 H20, Class FA, 4,147 %, fällig 20.04.2070 *	8.729	0,70
6.139 Ginnie Mae II Pool 'MA8877', 4,500 %, fällig 20.05.2053	6.105	0,49	27.067 Government National Mortgage Association, Series 2021 110, Class IO, 0,876 %, fällig 16.11.2063 *	1.828	0,15
1.006 Ginnie Mae II Pool 'MA8945', 4,000 %, fällig 20.06.2053	977	0,08	592 Government National Mortgage Association, Series 2021 119, Class HC, 1,000 %, fällig 20.07.2051	467	0,04
774 Ginnie Mae II Pool 'MA9011', 2,500 %, fällig 20.07.2053	685	0,06	7.008 Government National Mortgage Association, Series 2021 121, Class CI, 3,000 %, fällig 20.07.2051	1.172	0,09
18.300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,000 % ±	15.509	1,25	48.874 Government National Mortgage Association, Series 2021 128, Class IO, 0,992 %, fällig 16.06.2061 *	3.138	0,25
18.700 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 2,500 % ±	16.505	1,33	2.121 Government National Mortgage Association, Series 2021 135, Class A, 2,000 %, fällig 20.08.2051	1.797	0,14
9.300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,000 % ±	8.532	0,69	8.000 Government National Mortgage Association, Series 2021 139, Class IE, 3,500 %, fällig 20.08.2051	1.510	0,12
6.000 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 3,500 % ±	5.632	0,45	1.166 Government National Mortgage Association, Series 2021 14, Class AB, 1,340 %, fällig 16.06.2063	882	0,07
13.300 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,000 % ±	13.348	1,07	5.808 Government National Mortgage Association, Series 2021 156, Class IE, 2,500 %, fällig 20.09.2051	909	0,07
6.500 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	6.584	0,53	10.732 Government National Mortgage Association, Series 2021 158, Class IN, 2,500 %, fällig 20.09.2051	1.538	0,12
9.100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	9.284	0,75	3.327 Government National Mortgage Association, Series 2021 180, Class IO, 0,916 %, fällig 16.11.2063 *	232	0,02
46 Government National Mortgage Association, Series 2010 H02, Class FA, 4,466 %, fällig 20.02.2060 *	46	–	13.997 Government National Mortgage Association, Series 2021 191, Class NI, 3,000 %, fällig 20.10.2051	2.578	0,21
143 Government National Mortgage Association, Series 2010 H20, Class AF, 4,127 %, fällig 20.10.2060 *	143	0,01	3.103 Government National Mortgage Association, Series 2021 21, Class AH, 1,400 %, fällig 16.06.2063	2.406	0,19
53 Government National Mortgage Association, Series 2010 H22, Class FE, 4,147 %, fällig 20.05.2059 *	52	–	6.337 Government National Mortgage Association, Series 2021 216, Class NI, 3,000 %, fällig 20.12.2051	1.175	0,09
82 Government National Mortgage Association, Series 2010 H28, Class FE, 4,197 %, fällig 20.12.2060 *	82	0,01	1.658 Government National Mortgage Association, Series 2021 26, Class AI, 2,000 %, fällig 20.02.2051	215	0,02
18.381 Government National Mortgage Association, Series 2013 72, Class IO, 0,566 %, fällig 16.11.2047 *	366	0,03	14.712 Government National Mortgage Association, Series 2021 26, Class NI, 2,000 %, fällig 20.02.2051	1.598	0,13
6.887 Government National Mortgage Association, Series 2013 93, Class SA, 2,426 %, fällig 16.06.2043 *	882	0,07	749 Government National Mortgage Association, Series 2021 29, Class AG, 5,000 %, fällig 20.02.2051	761	0,06
6.271 Government National Mortgage Association, Series 2014 118, Class ZD, 2,500 %, fällig 16.08.2044	5.720	0,46	46.132 Government National Mortgage Association, Series 2021 37, Class IO, 0,797 %, fällig 16.01.2061 *	2.751	0,22
647 Government National Mortgage Association, Series 2014 2, Class CI, 4,500 %, fällig 20.01.2044	134	0,01	5.879 Government National Mortgage Association, Series 2021 46, Class NI, 2,500 %, fällig 20.03.2051	994	0,08
2.734 Government National Mortgage Association, Series 2015 177, Class MI, 5,000 %, fällig 20.10.2044	535	0,04	27.986 Government National Mortgage Association, Series 2021 5, Class IO, 1,111 %, fällig 16.01.2061 *	2.263	0,18
2.136 Government National Mortgage Association, Series 2015 20, Class PI, 3,500 %, fällig 20.02.2045	360	0,03	27.985 Government National Mortgage Association, Series 2021 60, Class IO, 0,826 %, fällig 16.05.2063 *	1.709	0,14
1.493 Government National Mortgage Association, Series 2015 36, Class DY, 3,000 %, fällig 20.03.2045	1.376	0,11	28.239 Government National Mortgage Association, Series 2021 70, Class IO, 0,700 %, fällig 16.04.2063 *	1.480	0,12
23.898 Government National Mortgage Association, Series 2017 111, Class IO, 0,527 %, fällig 16.02.2059 *	715	0,06	498 Government National Mortgage Association, Series 2021 8, Class AQ, 5,000 %, fällig 20.01.2051	505	0,04
2.725 Government National Mortgage Association, Series 2017 26, Class IQ, 5,000 %, fällig 20.02.2040	539	0,04	2.987 Government National Mortgage Association, Series 2021 9, Class MI, 2,500 %, fällig 20.01.2051	442	0,04
6.511 Government National Mortgage Association, Series 2017 8, Class IO, 0,442 %, fällig 16.08.2058 *	117	0,01	25.050 Government National Mortgage Association, Series 2021 97, Class TI, 3,000 %, fällig 20.08.2050	3.450	0,28
171 Government National Mortgage Association, Series 2017 H22, Class JF, 4,344 %, fällig 20.10.2067 *	172	0,01	576 Government National Mortgage Association, Series 2021 H02, Class TF, 5,077 %, fällig 20.01.2071 *	589	0,05
2.135 Government National Mortgage Association, Series 2018 134, Class SM, 2,418 %, fällig 20.10.2048 *	254	0,02	5.400 Government National Mortgage Association, Series 2022 102, Class CB, 2,250 %, fällig 16.06.2064 *	3.288	0,26
600 Government National Mortgage Association, Series 2018 168, Class PA, 4,000 %, fällig 20.08.2048	592	0,05	1.100 Government National Mortgage Association, Series 2022 139, Class AL, 4,000 %, fällig 20.07.2051	1.031	0,08
523 Government National Mortgage Association, Series 2018 37, Class QA, 2,750 %, fällig 20.03.2048	477	0,04	9.200 Government National Mortgage Association, Series 2022 147, Class B, 2,200 %, fällig 16.10.2063	6.661	0,54
500 Government National Mortgage Association, Series 2019 128, Class AL, 2,500 %, fällig 20.10.2049	359	0,03	9.177 Government National Mortgage Association, Series 2022 158, Class AL, 2,100 %, fällig 16.08.2064	6.686	0,54
7.333 Government National Mortgage Association, Series 2019 137, Class PI, 3,500 %, fällig 20.11.2049	1.462	0,12	4.335 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	193	0,02
470 Government National Mortgage Association, Series 2019 18, Class TP, 3,500 %, fällig 20.02.2049	436	0,04	7.634 Government National Mortgage Association, Series 2022 5, Class LI, 3,500 %, fällig 20.01.2052	1.346	0,11
26 Government National Mortgage Association, Series 2019 H01, Class FT, 4,197 %, fällig 20.10.2068 *	26	–	1.348 Government National Mortgage Association, Series 2022 50, Class NI, 3,000 %, fällig 20.09.2048	197	0,02
983 Government National Mortgage Association, Series 2019 H10, Class FB, 4,397 %, fällig 20.06.2069 *	985	0,08	3.352 Government National Mortgage Association, Series 2022 54, Class Z, 2,000 %, fällig 16.10.2063 *	1.446	0,12
4.925 Government National Mortgage Association, Series 2019 H20, Class AF, 4,447 %, fällig 20.11.2069 *	4.948	0,40	37.150 Government National Mortgage Association, Series 2022 55, Class IO, 0,565 %, fällig 16.01.2063 *	1.516	0,12
4.364 Government National Mortgage Association, Series 2020 116, Class GI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	663	0,05	1.900 Government National Mortgage Association, Series 2022 63, Class LM, 3,500 %, fällig 20.10.2050	1.666	0,13
32.166 Government National Mortgage Association, Series 2020 117, Class IO, 0,793 %, fällig 16.05.2062 *	1.962	0,16	1.300 Government National Mortgage Association, Series 2022 86, Class C, 2,250 %, fällig 16.10.2063 *	741	0,06
1.496 Government National Mortgage Association, Series 2020 122, Class IM, 2,500 %, fällig 20.08.2050	223	0,02	1.274 Government National Mortgage Association, Series 2022 H08, Class FE, 4,453 %, fällig 20.03.2072 *	1.280	0,10
2.930 Government National Mortgage Association, Series 2020 123, Class EI, 2,500 %, fällig 20.08.2050	421	0,03			
361 Government National Mortgage Association, Series 2020 129, Class IE, 2,500 %, fällig 20.09.2050	53	–			
130 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class IH, 2,500 %, fällig 20.10.2050	18	–			
4.781 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class QI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	828	0,07			
189 Government National Mortgage Association, Series 2020 160, Class VI, 2,500 %, fällig 20.10.2050	28	–			
1.207 Government National Mortgage Association, Series 2020 17, Class EU, 2,500 %, fällig 20.10.2049	1.099	0,09			
3.527 Government National Mortgage Association, Series 2020 181, Class WI, 2,000 %, fällig 20.12.2050	394	0,03			
1.133 Government National Mortgage Association, Series 2020 187, Class MI, 3,000 %, fällig 20.12.2050	211	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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – (Fortsetzung)			Organismen für gemeinsame Anlagen – 8,96 % (28. Februar 2025: 6,38 %)		
2.073 Government National Mortgage Association, Series 2022 H09, Class FA, 4,332 %, fällig 20.04.2072 *	2.072	0,17	111.548 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	111.548	8,96
33.520 Government National Mortgage Association, Series 2023 179, Class IO, 0,611 %, fällig 16.09.2063 *	1.489	0,12	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 111.548 \$)	111.548	8,96
6.846 Government National Mortgage Association, Series 2023 8, Class AZ, 3,750 %, fällig 16.01.2065	5.103	0,41	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.375.623 \$)	1.378.216	110,70
6.487 Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class AH, 2,000 %, fällig 16.06.2064	5.065	0,41	Futures – 0,03 % (28. Februar 2025: 0,14 %)		
5.897 Government National Mortgage Association, Series 2023 92, Class IA, 0,611 %, fällig 16.06.2064 *	307	0,02	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	360	0,03
35.031 Government National Mortgage Association, Series 2024 175, Class CS, 2,358 %, fällig 20.10.2054 *	3.042	0,24	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.378.576	110,73
40.045 Government National Mortgage Association, Series 2025 H23, Class DI, 0,974 %, fällig 20.10.2075 *	2.197	0,18	Futures – -0,03 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
2.120 GS Mortgage Securities Trust 2017-GS8, Series 2017 GS8, Class A4, 3,469 %, fällig 10.11.2050	2.097	0,17	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-311	-0,03
439 MF1 2021-FL7 Ltd, Series 2021 FL7, Class A, 144A, 4,861 %, fällig 16.10.2036 *	440	0,04	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-311	-0,03
2.960 MF1 2025-FL17 LLC, Series 2025 FL17, Class A, 144A, 4,984 %, fällig 18.02.2040 *	2.963	0,24	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.378.265	110,70
720 New Residential Mortgage Loan Trust 2018-3, Series 2018 3A, Class A1, 144A, 4,500 %, fällig 25.05.2058 *	716	0,06	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-133.209	-10,70
958 New Residential Mortgage Loan Trust 2021-NQM3, Series 2021 NQM3, Class A1, 144A, 1,156 %, fällig 27.11.2056 *	887	0,07	Gesamtvermögen	1.245.056 \$	100,00
1.677 OBX 2025-NQM8 Trust, Series 2025 NQM8, Class A3, 144A, 5,826 %, fällig 25.03.2065	1.695	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 %.		
2.200 PFP 2026-13 Ltd, Series 2026 13, Class A, 144A, 5,166 %, fällig 18.08.2043 *	2.209	0,18	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 49.294.000 \$ und machten 3,97 % des Nettovermögens aus.		
3.000 STWD 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,116 %, fällig 19.11.2042 *	3.006	0,24	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
2.511 Verus Securitization Trust 2025-R1, Series 2025 R1, Class A3, 144A, 5,774 %, fällig 25.05.2065	2.543	0,20	± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.		
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 1.233.377 \$)	1.236.380	99,31	ABKÜRZUNGEN:		
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,16 %) USA – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,16 %)			REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit.		
2.000 PG&E Wildfire Recovery Funding LLC, Series A-4, 5,212 %, fällig 01.12.2047	1.992	0,16	TBA – wird noch bekannt gegeben.		
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.034 \$)	1.992	0,16			
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,36 % (28. Februar 2025: 2,12 %) USA – 0,36 % (28. Februar 2025: 2,12 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		% des Gesamtvermögens
4.320 United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	4.299	0,34	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	87,90	
200 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2030	201	0,02	Organismen für gemeinsame Anlagen	7,74	
	4.500	0,36	Finanzderivate	0,02	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.519 \$)	4.500	0,36	Sonstige Vermögenswerte	4,34	
			Gesamtvermögen	100,00	

Aufstellung der Terminkontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 YearNote (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	-331	\$ -37.672	\$ -311
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	226	26.382	160
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Bank of America Merrill Lynch	170	20.140	200
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.668 \$)				\$ 360
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-311
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.668 \$)				\$ 49

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 15,48 % (28. Februar 2025: 16,48 %)			USA – 21,73 % (28. Februar 2025: 25,38 %)		
100 BANK 2017-BNK7, Series 2017 BNK7, Class C, 3,971 %, fällig 15.09.2060 *	91	0,49	10 Abbott Laboratories, 3,750 %, fällig 30.11.2026	10	0,05
7.098 Benchmark 2018-B7 Mortgage Trust, Series 2018 B7, Class XA, 0,403 %, fällig 15.05.2053 *	56	0,30	10 Abbott Laboratories, 4,750 %, fällig 30.11.2036	10	0,05
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 6,767 %, fällig 25.10.2041 *	101	0,55	20 Abbott Laboratories, 4,900 %, fällig 30.11.2046	19	0,10
100 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R03, Series 2021 R03, Class 1B1, 144A, 6,417 %, fällig 25.12.2041 *	101	0,55	10 AbbVie Inc, 4,800 %, fällig 15.03.2029	10	0,06
16 Fannie Mae Pool 'AS0038', 3,000 %, fällig 01.07.2043	15	0,08	80 AbbVie Inc, 3,200 %, fällig 21.11.2029	78	0,42
69 Fannie Mae Pool 'BR4393', 2,000 %, fällig 01.03.2051	57	0,31	10 AbbVie Inc, 4,950 %, fällig 15.03.2031	10	0,06
107 Fannie Mae Pool 'CA5220', 3,000 %, fällig 01.02.2050	97	0,52	10 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	10	0,06
65 Fannie Mae Pool 'CB1878', 3,000 %, fällig 01.10.2051	60	0,32	20 AbbVie Inc, 4,250 %, fällig 21.11.2049	17	0,09
142 Fannie Mae Pool 'CB2164', 3,000 %, fällig 01.11.2051	130	0,70	10 Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 01.02.2028	10	0,06
73 Fannie Mae Pool 'CB2375', 2,500 %, fällig 01.12.2051	65	0,35	20 Alphabet Inc, 1,100 %, fällig 15.08.2030	18	0,10
221 Fannie Mae Pool 'FM3445', 4,000 %, fällig 01.09.2048	218	1,17	10 Alphabet Inc, 4,100 %, fällig 15.02.2031	10	0,05
71 Fannie Mae Pool 'FM9195', 2,500 %, fällig 01.10.2051	62	0,34	10 Alphabet Inc, 4,700 %, fällig 15.11.2035	10	0,05
67 Fannie Mae Pool 'FM9292', 3,000 %, fällig 01.11.2051	62	0,33	30 Alphabet Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	31	0,16
73 Fannie Mae Pool 'FM9579', 2,000 %, fällig 01.07.2051	61	0,33	10 Alphabet Inc, 5,350 %, fällig 15.11.2045	10	0,05
72 Fannie Mae Pool 'FS0584', 2,000 %, fällig 01.02.2052	60	0,32	20 Alphabet Inc, 5,500 %, fällig 15.02.2046	20	0,11
69 Fannie Mae Pool 'FS1107', 2,500 %, fällig 01.12.2051	61	0,33	10 Alphabet Inc, 2,050 %, fällig 15.08.2050	11	0,06
143 Fannie Mae Pool 'FS2740', 3,500 %, fällig 01.06.2049	137	0,74	10 Alphabet Inc, 5,250 %, fällig 15.05.2055	10	0,05
62 Fannie Mae Pool 'MA4158', 2,000 %, fällig 01.10.2050	52	0,28	20 Alphabet Inc, 5,650 %, fällig 15.02.2056	21	0,11
70 Fannie Mae Pool 'MA4305', 2,000 %, fällig 01.04.2051	59	0,32	10 Alphabet Inc, 5,300 %, fällig 15.05.2065	10	0,05
58 Freddie Mac Pool 'RA3913', 2,500 %, fällig 01.11.2050	51	0,28	8 Altria Group Inc, 4,800 %, fällig 14.02.2029	8	0,04
64 Freddie Mac Pool 'RA5921', 2,500 %, fällig 01.09.2051	56	0,30	20 Altria Group Inc, 5,800 %, fällig 14.02.2039	21	0,11
57 Freddie Mac Pool 'RB5130', 1,500 %, fällig 01.10.2041	49	0,26	30 Altria Group Inc, 5,950 %, fällig 14.02.2049	30	0,16
14 Freddie Mac Pool 'RB5134', 1,500 %, fällig 01.11.2041	12	0,07	40 Amazon.com Inc, 1,500 %, fällig 03.06.2030	36	0,20
294 Freddie Mac Pool 'SD0176', 3,500 %, fällig 01.12.2049	279	1,50	50 Amazon.com Inc, 2,500 %, fällig 03.06.2050	30	0,16
72 Freddie Mac Pool 'SD0777', 2,500 %, fällig 01.11.2051	64	0,34	10 Aon North America Inc, 5,450 %, fällig 01.03.2034	10	0,06
103 Ginnie Mae II Pool 'MA6658', 4,000 %, fällig 20.05.2050	101	0,54	20 Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032	21	0,11
173 Ginnie Mae II Pool 'MA7473', 3,000 %, fällig 20.07.2051	159	0,86	50 AT&T Inc, 1,650 %, fällig 01.02.2028	48	0,26
184 Ginnie Mae II Pool 'MA7590', 3,000 %, fällig 20.09.2051	169	0,91	10 Ball Corp, 3,125 %, fällig 15.09.2031	9	0,05
71 Ginnie Mae II Pool 'MA7883', 3,500 %, fällig 20.02.2052	67	0,36	20 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,250 %, fällig 15.01.2049	17	0,09
100 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 4,500 % ±	99	0,53	20 Black Pearl Compute LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2031	21	0,11
92 Government National Mortgage Association, Series 2022 3, Class IO, 0,640 %, fällig 16.02.2061 *	4	0,02	20 Block Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.08.2033	20	0,11
250 Towd Point Mortgage Trust 2017-4, Series 2017 4, Class B2, 144A, 3,646 %, fällig 25.06.2057 *	220	1,18	10 Blue Racer Midstream LLC / Blue Racer Finance Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.07.2032	11	0,06
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 3.086 \$)	2.875	15,48	20 Boeing Co/The, 5,705 %, fällig 01.05.2040	21	0,11
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 27,83 % (28. Februar 2025: 34,12 %)			10 Boeing Co/The, 6,858 %, fällig 01.05.2054	12	0,06
Australien – 0,50 % (28. Februar 2025: 0,43 %)			20 BP Capital Markets America Inc, 3,633 %, fällig 06.04.2030	20	0,11
20 Glencore Finance Canada Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2041	21	0,11	10 Bristol-Myers Squibb Co, 5,100 %, fällig 22.02.2031	10	0,06
40 Glencore Funding LLC, 144A, 4,000 %, fällig 27.03.2027	40	0,22	10 Bristol-Myers Squibb Co, 5,200 %, fällig 22.02.2034	11	0,06
20 Glencore Funding LLC, 144A, 5,673 %, fällig 01.04.2035	21	0,11	30 Broadcom Inc, 5,200 %, fällig 15.07.2035	31	0,17
10 Glencore Funding LLC, 144A, 6,141 %, fällig 01.04.2055	11	0,06	10 Broadcom Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	10	0,05
	93	0,50	20 Builders FirstSource Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.05.2035	21	0,11
Belgien – 0,21 % (28. Februar 2025: 0,21 %)			70 Carnival Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2031	73	0,39
40 Anheuser-Busch InBev Worldwide Inc, 3,500 %, fällig 01.06.2030	39	0,21	40 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	41	0,22
Brasilien – 0,90 % (28. Februar 2025: 0,88 %)			40 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	37	0,20
110 Petrobras Global Finance BV, 5,750 %, fällig 01.02.2029	113	0,61	30 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2036	30	0,16
60 Suzano Austria GmbH, Serie DM3N, 3,125 %, fällig 15.01.2032	54	0,29	20 Charles Schwab Corp/The, 5,875 %, fällig 24.08.2026	20	0,11
	167	0,90	10 Charles Schwab Corp/The, 6,136 %, fällig 24.08.2034 *	11	0,06
Kanada – 0,34 % (28. Februar 2025: 1,08 %)			80 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	80	0,43
20 Barrick North America Finance LLC, 5,700 %, fällig 30.05.2041	21	0,11	40 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,375 %, fällig 01.04.2038	37	0,20
10 Bombardier Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.06.2033	11	0,06	10 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	9	0,05
20 CI Financial Corp, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2029	21	0,12	20 Chord Energy Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.10.2030	20	0,11
10 Rogers Communications Inc, 5,300 %, fällig 15.02.2034	10	0,05	30 Cigna Group/The, 4,375 %, fällig 15.10.2028	30	0,16
	63	0,34	200 Citigroup Inc, 2,572 %, fällig 03.06.2031 *	187	1,01
Kolumbien – 0,41 % (28. Februar 2025: 0,39 %)			10 Citigroup Inc, 8,125 %, fällig 15.07.2039	13	0,07
100 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	75	0,41	50 Citigroup Inc, 4,650 %, fällig 23.07.2048	45	0,24
Frankreich – 1,08 % (28. Februar 2025: 1,08 %)			50 Coca-Cola Co/The, 2,500 %, fällig 15.03.2051	31	0,17
200 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	201	1,08	30 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 6,036 %, fällig 15.11.2033	33	0,18
Israel – 0,26 % (28. Februar 2025: 0,63 %)			40 Comcast Corp, 4,150 %, fällig 15.10.2028	40	0,22
48 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 3,150 %, fällig 01.10.2026	48	0,26	10 Consolidated Edison Co of New York Inc, Series 20A, 3,350 %, fällig 01.04.2030	10	0,05
Supranational – 1,20 % (28. Februar 2025: 1,27 %)			50 Coterra Energy Inc, 4,375 %, fällig 15.03.2029	51	0,27
INR 20.000 Inter-American Development Bank, 7,350 %, fällig 06.10.2030	224	1,20	10 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.01.2033	10	0,05
Vereinigtes Königreich – 1,20 % (28. Februar 2025: 1,20 %)			30 Deere & Co, 3,750 %, fällig 15.04.2050	24	0,13
11 BAT Capital Corp, 3,557 %, fällig 15.08.2027	11	0,06	55 Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	56	0,30
40 BAT Capital Corp, 4,540 %, fällig 15.08.2047	34	0,18	10 Devon Energy Corp, 5,000 %, fällig 15.06.2045	9	0,05
200 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	178	0,96	10 Diamondback Energy Inc, 3,500 %, fällig 01.12.2029	10	0,05
	223	1,20	10 DISH DBS Corp, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2026 †	10	0,05
			30 Elevance Health Inc, 3,650 %, fällig 01.12.2027	30	0,16
			10 Eli Lilly & Co, 4,700 %, fällig 09.02.2034	10	0,06
			20 Energy Transfer LP, 5,250 %, fällig 15.04.2029	21	0,11
			20 Energy Transfer LP, 6,250 %, fällig 15.04.2049	20	0,11
			10 Energy Transfer LP, Series G, 7,125 %, Ewige Anleihe *	10	0,06
			30 Enterprise Products Operating LLC, 5,550 %, fällig 16.02.2055	30	0,16

[^] 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 2026 – (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)					
20 EOG Resources Inc, 4,375 %, fällig 15.04.2030	20	0,11	10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 5,250 %, fällig 27.02.2038	10	0,05
20 EOG Resources Inc, 4,950 %, fällig 15.04.2050	18	0,10	40 RTX Corp, 2,250 %, fällig 01.07.2030	37	0,20
150 EQT Corp, 5,000 %, fällig 15.01.2029	153	0,82	10 RTX Corp, 6,000 %, fällig 15.03.2031	11	0,06
10 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	11	0,06	10 RTX Corp, 4,500 %, fällig 01.06.2042	9	0,05
10 Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	10	0,05	10 Sekisui House US Inc, 6,000 %, fällig 15.01.2043	10	0,05
10 Florida Power & Light Co, 5,700 %, fällig 15.03.2055	10	0,06	4 Solventum Corp, 5,400 %, fällig 01.03.2029	4	0,02
20 General Motors Co, 5,950 %, fällig 01.04.2049	20	0,11	20 Solventum Corp, 5,450 %, fällig 13.03.2031	21	0,11
10 Georgia Power Co, 5,200 %, fällig 15.03.2035	10	0,06	20 Solventum Corp, 5,900 %, fällig 30.04.2054	20	0,11
20 GFL Environmental Holdings US Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.02.2034	20	0,11	20 SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	20	0,11
10 GFL Environmental Inc, 144A, 4,000 %, fällig 01.08.2028	10	0,05	10 Synopsys Inc, 4,850 %, fällig 01.04.2030	10	0,06
120 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,516 %, fällig 21.01.2032 *	121	0,65	10 Synopsys Inc, 5,000 %, fällig 01.04.2032	10	0,06
20 Gulfstream Natural Gas System LLC, 144A, 5,600 %, fällig 23.07.2035	21	0,11	10 Synopsys Inc, 5,700 %, fällig 01.04.2055	10	0,05
10 Herc Holdings Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.06.2030	11	0,06	10 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	10	0,05
10 Herc Holdings Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2033	11	0,06	10 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	10	0,05
10 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2033	10	0,06	10 T-Mobile USA Inc, 3,875 %, fällig 15.04.2030	10	0,05
20 Home Depot Inc/The, 3,250 %, fällig 15.04.2032	19	0,10	70 T-Mobile USA Inc, 2,550 %, fällig 15.02.2031	65	0,35
40 Home Depot Inc/The, 3,300 %, fällig 15.04.2040	33	0,18	10 T-Mobile USA Inc, 2,875 %, fällig 15.02.2031	9	0,05
10 Honeywell International Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2035	10	0,06	20 T-Mobile USA Inc, 3,500 %, fällig 15.04.2031	19	0,10
20 Humana Inc, 3,700 %, fällig 23.03.2029	20	0,11	10 T-Mobile USA Inc, 5,150 %, fällig 15.04.2034	10	0,06
10 Intel Corp, 5,125 %, fällig 10.02.2030	10	0,06	10 T-Mobile USA Inc, 5,875 %, fällig 15.11.2055	10	0,05
10 Intel Corp, 5,700 %, fällig 10.02.2053	10	0,05	10 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	10	0,05
20 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	21	0,11	50 Union Pacific Corp, 2,891 %, fällig 06.04.2036	43	0,23
20 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.05.2033	21	0,11	40 Union Pacific Corp, 3,839 %, fällig 20.03.2060	30	0,16
20 JPMorgan Chase & Co, 5,576 %, fällig 23.07.2036 *	21	0,11	10 United Airlines Holdings Inc, 5,375 %, fällig 01.03.2031	10	0,06
10 JPMorgan Chase & Co, 3,897 %, fällig 23.01.2049 *	8	0,04	20 United Airlines Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.04.2029	20	0,11
10 Kenvue Inc, 4,900 %, fällig 22.03.2033	10	0,06	80 United Rentals North America Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2034	84	0,45
10 Kinder Morgan Inc, 5,200 %, fällig 01.03.2048	9	0,05	40 UnitedHealth Group Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	37	0,20
10 Kroger Co/The, 5,000 %, fällig 15.09.2034	10	0,05	20 UnitedHealth Group Inc, 2,750 %, fällig 15.05.2040	15	0,08
20 Las Vegas Sands Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2028	21	0,11	20 UnitedHealth Group Inc, 3,700 %, fällig 15.08.2049	15	0,08
10 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 15.08.2029	10	0,06	10 US Bancorp, 5,775 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,06
10 Las Vegas Sands Corp, 6,000 %, fällig 14.06.2030	11	0,06	10 US Bancorp, 5,836 %, fällig 12.06.2034 *	11	0,06
30 Mars Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2032	31	0,17	10 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,500 %, fällig 15.06.2034	11	0,06
10 Medline Borrower LP/Medline Co-Issuer Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.04.2029	10	0,06	20 Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	21	0,12
30 Merck & Co Inc, 1,450 %, fällig 24.06.2030	27	0,15	10 Verizon Communications Inc, 4,500 %, fällig 10.08.2033	10	0,05
30 Meta Platforms Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	31	0,16	10 Versant Media Group Inc, 144A, 7,250 %, fällig 30.01.2031	10	0,06
20 Meta Platforms Inc, 4,750 %, fällig 15.08.2034	20	0,11	20 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	21	0,11
10 Meta Platforms Inc, 4,875 %, fällig 15.11.2035	10	0,05	30 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2033	31	0,17
10 Meta Platforms Inc, 5,000 %, fällig 15.11.2045	10	0,05	10 Viper Energy Partners LLC, 5,700 %, fällig 01.08.2035	10	0,06
10 Meta Platforms Inc, 5,625 %, fällig 15.11.2055	10	0,05	20 Visa Inc, 2,050 %, fällig 15.04.2030	19	0,10
10 Meta Platforms Inc, 5,750 %, fällig 15.11.2065	10	0,05	30 Visa Inc, 4,300 %, fällig 14.12.2045	27	0,14
30 Michaels Cos Inc/The, 144A, 8,500 %, fällig 15.03.2033	29	0,16	10 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	10	0,06
20 Micron Technology Inc, 6,050 %, fällig 01.11.2035	22	0,12	10 Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	9	0,05
20 Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	21	0,11	20 Williams Cos Inc/The, 4,850 %, fällig 01.03.2048	18	0,10
10 Millrose Properties Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2032	10	0,05		4.036	21,73
70 Morgan Stanley, 3,622 %, fällig 01.04.2031 *	68	0,37	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.561 \$)		
20 MPLX LP, 4,800 %, fällig 15.02.2029	20	0,11		5.169	27,83
10 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.01.2031	10	0,05	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 45,09 % (28. Februar 2025: 32,35 %)		
20 NIKE Inc, 3,375 %, fällig 27.03.2050	15	0,08	Brasilien – 1,41 % (28. Februar 2025: 1,35 %)		
40 Northrop Grumman Corp, 3,250 %, fällig 15.01.2028	40	0,21	BRL 579 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	97	0,52
20 Northrop Grumman Corp, 5,250 %, fällig 01.05.2050	19	0,10	200 Brasilien, Internationale Staatsanleihe, 5,000 %, fällig 27.01.2045	165	0,89
10 NRG Energy Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2034	10	0,05		262	1,41
10 NRG Energy Inc, 144A, 5,407 %, fällig 15.10.2035	10	0,05	Tschechische Republik – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
50 NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	51	0,27	CZK 1.290 Tschechische Republik, Staatsanleihe, Serie 103, 2,000 %, fällig 13.10.2033	55	0,29
10 Oglethorpe Power Corp, 5,900 %, fällig 01.02.2055	10	0,05	Indonesien – 1,00 % (28. Februar 2025: 1,00 %)		
10 Oncor Electric Delivery Co LLC, 144A, 5,350 %, fällig 01.04.2035	10	0,06	200 Indonesien, Internationale Staatsanleihe, 4,625 %, fällig 15.04.2043	186	1,00
20 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	10	0,05	Malaysia – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
10 ONEOK Inc, 5,650 %, fällig 01.11.2028	21	0,11	MYR 200 Malaysia, Staatsanleihe, Serie 0415, 4,254 %, fällig 31.05.2035	54	0,29
10 Oracle Corp, 5,350 %, fällig 04.05.2033	10	0,05	Mexiko – 1,12 % (28. Februar 2025: 0,80 %)		
10 Oracle Corp, 5,700 %, fällig 04.02.2036	10	0,05	MXN 1.050 Mexiko, Bonos, Serie M, 7,750 %, fällig 13.11.2042	54	0,29
20 Oracle Corp, 3,600 %, fällig 01.04.2050	13	0,07	200 Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 4,350 %, fällig 15.01.2047	153	0,83
10 Oracle Corp, 6,850 %, fällig 04.02.2066	10	0,05		207	1,12
10 Petco Health & Wellness Co Inc, 144A, 8,250 %, fällig 01.02.2031	10	0,05	Peru – 0,81 % (28. Februar 2025: 0,17 %)		
10 Philip Morris International Inc, 4,875 %, fällig 13.02.2029	10	0,06	PEN 80 Peru, Staatsanleihe, 5,400 %, fällig 12.08.2034	24	0,13
20 Philip Morris International Inc, 2,100 %, fällig 01.05.2030	19	0,10	90 Peru, Internationale Staatsanleihe, 5,500 %, fällig 30.03.2036	93	0,50
10 Philip Morris International Inc, 5,250 %, fällig 13.02.2034	11	0,06	30 Peru, Internationale Staatsanleihe, 6,550 %, fällig 14.03.2037	34	0,18
20 Philip Morris International Inc, 4,500 %, fällig 20.03.2042	18	0,10		151	0,81
10 PM General Purchaser LLC, 144A, 9,500 %, fällig 01.10.2028	9	0,05	Südafrika – 0,30 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
10 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,582 %, fällig 12.06.2029 *	10	0,06	ZAR 870 Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2044, 8,750 %, fällig 31.01.2044	55	0,30
20 Quikrete Holdings Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2032	21	0,11			
20 QXO Building Products Inc, 144A, 6,750 %, fällig 30.04.2032	21	0,11			
30 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 30.09.2031	31	0,17			
10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2032	10	0,06			
10 Royal Caribbean Cruises Ltd, 4,750 %, fällig 15.05.2033	10	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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Schuldscheindarlehen – 4,01 % (28. Februar 2025: 2,75 %)		
USA – 39,87 % (28. Februar 2025: 29,03 %)			Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 755 \$)		
110 United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.01.2033 ^β	118	0,63	48 1011778 Bc Ulc, 5,422 %, fällig 23.09.2030 *	48	0,26
10 United States Treasury Note/Bond, 2,750 %, fällig 30.04.2027	10	0,05	40 AmWINS Group Inc, 5,672 %, fällig 30.01.2032 *	40	0,21
190 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.07.2027	191	1,03	20 Ascensus Holdings Inc, 6,672 %, fällig 20.11.2032 *	20	0,11
50 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2029	51	0,28	30 Asurion LLC, 0,000 %, fällig 14.02.2033 *	30	0,16
10 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 30.11.2029	10	0,06	30 AthenaHealth Group Inc, 6,422 %, fällig 15.02.2029 *	29	0,16
190 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.03.2030	194	1,04	48 Citadel Securities LP, 5,672 %, fällig 24.10.2031 *	48	0,26
110 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.01.2031	112	0,61	30 Cloud Software Group Inc, 0,000 %, fällig 24.03.2031 *	28	0,15
280 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 28.02.2031	289	1,56	20 Cloudera Inc, 7,566 %, fällig 10.10.2028 *	18	0,10
870 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 31.05.2031	914	4,92	40 Corelogic Inc, 0,000 %, fällig 02.06.2028 *	38	0,21
180 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2031	180	0,97	20 CRC Insurance Group LLC, 0,000 %, fällig 06.05.2031 *	20	0,11
10 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2032	9	0,05	30 Focus Financial Partners LLC, 6,172 %, fällig 15.09.2031 *	28	0,15
1.670 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 30.06.2032	1.702	9,16	10 Gainwell Acquisition Corp, 7,772 %, fällig 01.10.2027 *	9	0,05
230 United States Treasury Note/Bond, 1,750 %, fällig 15.08.2041	161	0,87	45 Grifols Worldwide Operations USA Inc, 5,972 %, fällig 15.11.2027 *	44	0,24
10 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.02.2042	8	0,04	30 Harbor Freight Tools, 5,922 %, fällig 05.06.2031 *	29	0,16
70 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	66	0,36	40 HUB International Ltd, 0,000 %, fällig 20.06.2030 *	40	0,21
20 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.02.2043	19	0,10	30 Jane Street Group LLC, 5,822 %, fällig 15.12.2031 *	29	0,16
80 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.05.2043	74	0,40	25 Jazz Financing Lux S.a.r.l., 5,922 %, fällig 05.05.2028 *	25	0,13
60 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	62	0,33	10 Medline Borrower LP, 5,422 %, fällig 23.10.2028 *	10	0,05
10 United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 15.05.2045	11	0,06	40 Nexstar Media Inc, 6,172 %, fällig 24.06.2032 *	40	0,21
20 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 15.08.2045	21	0,11	30 Petco Health & Wellness Co Inc, 7,921 %, fällig 22.01.2031 *	29	0,16
110 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.02.2049	84	0,45	19 Quikrete Holdings, Inc., 5,922 %, fällig 26.03.2029 *	19	0,10
50 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2049	37	0,20	30 Sedgwick Claims Management Services, 6,172 %, fällig 31.07.2031 *	29	0,16
50 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.08.2049	33	0,18	28 Sotera Health Holdings LLC, 6,172 %, fällig 30.05.2031 *	28	0,15
200 United States Treasury Note/Bond, 1,375 %, fällig 15.08.2050	103	0,55	30 UKG Inc, 6,167 %, fällig 10.02.2031 *	28	0,15
230 United States Treasury Note/Bond, 1,625 %, fällig 15.11.2050	126	0,68	10 Versant Media Group Inc, 7,161 %, fällig 23.10.2030 *	10	0,05
230 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.02.2051	134	0,72	30 Virgin Media Bristol LLC, 7,052 %, fällig 31.03.2031 *	28	0,15
710 United States Treasury Note/Bond, 2,375 %, fällig 15.05.2051	466	2,51	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,30 % (28. Februar 2025: 8,98 %)		
50 United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.08.2051	30	0,16	1.170 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.170	6,30
370 United States Treasury Note/Bond, 1,875 %, fällig 15.11.2051	214	1,15	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.170 \$)		
62 United States Treasury Note/Bond, 2,250 %, fällig 15.02.2052	39	0,21	1.170	6,30	
247 United States Treasury Note/Bond, 2,875 %, fällig 15.05.2052	180	0,97	Optionsscheine – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
50 United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	37	0,20	1 Spirit Aviation Holdings †∞	–	–
40 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2052	36	0,19	– Spirit Aviation Holdings †∞	–	–
178 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.02.2053	149	0,81	1 Spirit Aviation Holdings †∞	1	0,01
490 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 15.05.2053	411	2,21	Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten 33 \$)		
260 United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.08.2053	239	1,29	1	0,01	
600 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2053	610	3,28	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 20.016 \$)		
60 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	56	0,30	18.334	98,72	
10 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.05.2054	10	0,05	Kontrakte (in Tsd.)		
140 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2054	131	0,71	Wert (in Tsd.) USD		
70 United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.11.2054	68	0,37	% vom Nettoinventarwert		
10 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2055	10	0,05	Gekaufte Optionen – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,57 %)		
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.411 \$)			– U.S. 5 Year W1 März 2026 Call 109.75, fällig 06.03.2026 – Morgan Stanley		
8.375	45,09		3	0,02	
			Summe gekaufte Optionen (Anschaffungskosten 2 \$)		
			3	0,02	
			Credit Default Swaps – 0,66 % (28. Februar 2025: 0,74 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			122	0,66	
			Zinsswaps – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			7	0,04	
			Swaptions – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			8	0,04	
			Devisenterminkontrakte – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,19 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			16	0,09	
			Futures – 0,41 % (28. Februar 2025: 0,40 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
			76	0,41	
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
			18.566	99,98	
			Kontrakte (in Tsd.)		
			Wert (in Tsd.) USD		
			% vom Nettoinventarwert		
			Verkaufte Optionen – -0,02 % (28. Februar 2025: -0,37 %)		
			– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Call 97.50, fällig 11.12.2026 – Morgan Stanley		
			-2	-0,01	
			– CME 3 Month SOFR Futures Dezember 2026 Put 96.50, fällig 11.12.2026 – Morgan Stanley		
			-1	-0,01	
			– CME 3 Month SOFR Futures September 2026 Call 97.50, fällig 11.09.2026 – Morgan Stanley		
			-1	–	
			Summe verkaufte Optionen (Anschaffungskosten -7 \$)		
			-4	-0,02	
			Index-Swaps – -0,12 % (28. Februar 2025: -0,23 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			-22	-0,12	
			Inflationsswaps – -0,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
			-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 2026 – (Fortsetzung)

Kontrakte (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Zinsswaps – -0,05 % (28. Februar 2025: -0,38 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-9	-0,05
Swaptions – -0,04 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-7	-0,04
Devisenterminkontrakte – -0,10 % (28. Februar 2025: -0,21 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-18	-0,10
Futures – -0,49 % (28. Februar 2025: -0,86 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-91	-0,49
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-160	-0,87
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	18.406	99,11
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	166	0,89
Gesamtnettovermögen	18.572 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.930.000 \$ und machten 10,40 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ± Wertpapiere wurden auf TBA-Basis gekauft.
- β Der Zinssatz eines Wertpapiers dieser Art ist an den Verbraucherpreisindex (CPI)/ Einzelhandelspreisindex (RPI) gebunden. Der Kuponsatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.

ABKÜRZUNGEN:

Ewige Anleihe	– Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.
TBA	– To be announced.
BRL	– Brasilianischer Real
CZK	– Tschechische Krone
INR	– Indische Rupie
MXN	– Mexikanischer Peso
MYR	– Malaysischer Ringgit
PEN	– Peruanischer Nuevo Sol
ZAR	– Südafrikanischer Rand

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	84,89
Sonstige übertragbare Wertpapiere, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	3,85
Organismen für gemeinsame Anlagen	6,05
Finanzderivate	1,20
Sonstige Vermögenswerte	4,01
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	CDX.NA.HY, 5.000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	639	\$ 43
Morgan Stanley	CDX.NA.IG, 1.000 % – Verkauf	20. Dez. 2030	4.054	79
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 136 \$)				\$ 122
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): 136 \$)				\$ 122

Aufstellung der Zinsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 10,262 %	02. Jan. 2029	540	\$ -9
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,250 %	02. Jan. 2031	1.610	2
JP Morgan	Zahlt variablen Zinssatz zum BRL CDI, erhält festen Zinssatz von 13,300 %	02. Jan. 2031	2.600	5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 7
Nicht realisierte Wertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -69 \$)				-9
Nettowertminderung aus Zinsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -69 \$)				\$ -2

Aufstellung der Index-Swaps

Gegenpartei	Referenzunternehmen	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,320 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR OIS Compound	15. Dez. 2027	7.006	\$ -12
Morgan Stanley	Zahlt festen Zinssatz von 3,420 %, erhält variablen Zinssatz zum USD SOFR OIS Compound	31. Aug. 2032	1.780	-10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -43 \$)				-22
Nettowertminderung aus Index-Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -43 \$)				\$ -22

Aufstellung der Inflationsswaps

Gegenpartei	Prozentsatz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Morgan Stanley	USD – CPI Urban Consumers	21. Nov. 2030	1.840	\$ -9
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-9
Nettowertminderung aus Inflationsswaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ -9

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung von Swaptions

Gegenpartei	Beschreibung	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	26. Sep. 2026	110	\$ –
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	490	-7
Goldman Sachs	Swaption Receiver Strike 0,03 %	28. Sep. 2026	2.160	8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 8
Nicht realisierte Wertminderung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-7
Nettowertsteigerung aus Swaptions (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 1

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	71	Verkauf	BRL	389	\$ -5
03. März 2026	JP Morgan	Kauf	BRL	388	Verkauf	USD	75	1
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	USD	403	Verkauf	GBP	299	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	40	Verkauf	USD	48	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	EUR	60	Verkauf	USD	71	–
16. Apr. 2026	BNP Paribas	Kauf	AUD	160	Verkauf	USD	113	–
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	28	Verkauf	AUD	40	-1
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	11	Verkauf	CAD	15	–
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	248	Verkauf	EUR	211	-2
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	EUR	140	Verkauf	USD	163	3
16. Apr. 2026	Citi	Kauf	CNH	371	Verkauf	USD	54	1
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	187	Verkauf	AUD	274	-7
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	105	Verkauf	CNH	731	-2
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	CNH	360	Verkauf	USD	52	–
16. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	AUD	301	Verkauf	USD	203	11
02. Jun. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	74	Verkauf	BRL	388	-1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 36 \$)								\$ 16
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): - 39 \$)								-18
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -3 \$)								\$ -2

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
3-Monats-SOFR-Index Dezember 2025	Morgan Stanley	39	\$ 9.390	\$ 12
3 Month SOFR Index März 2026	Morgan Stanley	17	4.095	-7
Australia 10 Year Bond März 2026	Morgan Stanley	4	315	5
Long Gilt Juni 2026	Morgan Stanley	3	379	5
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	2	227	1
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Morgan Stanley	-10	-1.167	-12
U.S. 2 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	7	1.465	2
U.S. 5 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	114	12.556	51
U.S. Long Bond (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	-16	-1.896	-13
U.S. Ultra Bond (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	-31	-3.769	-59
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 73 \$)				\$ 76
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -157 \$)				-91
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -84 \$)				\$ -15

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 3,14 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Supranational – 3,14 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
INR 23.500 Corp Andina de Fomento, 144A, 7,250 %, fällig 06.03.2036	254	0,55
INR 111.000 Inter-American Development Bank, 6,850 %, fällig 18.02.2036	1.206	2,59
	1.460	3,14
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.477 \$)	1.460	3,14
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 97,21 % (28. Februar 2025: 96,80 %)		
Australien – 13,18 % (28. Februar 2025: 2,59 %)		
AUD 4.370 Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	3.000	6,43
AUD 1.320 New South Wales Treasury Corp, 4,250 %, fällig 20.02.2036	871	1,87
AUD 1.910 Queensland Treasury Corp, 144A, 5,250 %, fällig 21.07.2036	1.357	2,91
AUD 1.350 Treasury Corp of Victoria, 4,750 %, fällig 15.09.2036	918	1,97
	6.146	13,18
Kanada – 1,67 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
CAD 1.070 Kanada, Schatzwechsel, Nullkupon, 0,000 %, fällig 12.08.2026	777	1,67
Kolumbien – 3,24 % (28. Februar 2025: 0,19 %)		
COP 6.740.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	1.509	3,24
Ungarn – 0,57 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
HUF 81.000 Ungarn, Staatsanleihe, Serie 35/A, 7,000 %, fällig 24.10.2035	265	0,57
Japan – 3,11 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
JPY 118.000 Japan, 40-jährige Staatsanleihe, Serie 18, 3,100 %, fällig 20.03.2065	700	1,50
JPY 116.000 Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 89, 3,400 %, fällig 20.12.2055	751	1,61
	1.451	3,11
Mexiko – 3,84 % (28. Februar 2025: 5,72 %)		
MXN 11.500 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 11.07.2047	596	1,28
MXN 17.000 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	875	1,88
MXN 6.200 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 29.04.2055	317	0,68
	1.788	3,84
Norwegen – 2,49 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
INR 20.000 Kommunalbanken AS, 144A, 7,000 %, fällig 05.03.2036	216	0,46
NOK 9.200 Norwegen, Staatsanleihe, Serie 479, 144A, 1,750 %, fällig 17.02.2027	947	2,03
	1.163	2,49
Vereinigtes Königreich – 13,40 % (28. Februar 2025: 23,40 %)		
GBP 2.220 Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	3.051	6,55
GBP 500 United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	310	0,66
GBP 2.380 United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	2.886	6,19
	6.247	13,40
USA – 55,71 % (28. Februar 2025: 64,90 %)		
8.660 United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027 *	8.671	18,60
9.320 United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027 *	9.336	20,03
360 United States Treasury Floating Rate Note, 3,742 %, fällig 31.01.2028 *	360	0,77
7.590 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027 *	7.599	16,31
	25.966	55,71
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 44.703 \$)	45.312	97,21

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	JP Morgan	Kauf USD 1.330	Verkauf CNH 9.350	\$ -33
03. März 2026	JP Morgan	Kauf CNH 9.350	Verkauf USD 1.354	9
13. März 2026	BNY	Kauf USD 28	Verkauf EUR 24	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 121	Verkauf EUR 103	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1	Verkauf GBP 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 82	Verkauf GBP 59	–
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 7.060	Verkauf USD 9.659	-143
13. März 2026	BNY	Kauf GBP –	Verkauf USD –	–
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 12.641	Verkauf USD 15.079	-136

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,79 % (28. Februar 2025: 2,23 %)		
837 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	837	1,79
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 837 \$)	837	1,79
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 47.017 \$)		
	47.609	102,14
Devisenterminkontrakte – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,84 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	136	0,29
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	47.745	102,43
Devisenterminkontrakte – -1,56 % (28. Februar 2025: -0,25 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-728	-1,56
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-728	-1,56
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	47.017	100,87
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
	-406	-0,87
Gesamtvermögen		
	46.611 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 2.774.000 \$ und machten 5,95 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
CAD	– Kanadischer Dollar
COP	– Kolumbianischer Peso
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HUF	– Ungarischer Forint
INR	– Indische Rupie
JPY	– Japanischer Yen
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,10
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,74
Finanzderivate	0,28
Sonstige Vermögenswerte	0,88
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	6	Verkauf	USD	7	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	188	Verkauf	USD	133	1
13. März 2026	Citi	Kauf	AUD	570	Verkauf	USD	395	11
13. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	1.433	Verkauf	AUD	2.120	-75
13. März 2026	HSBC	Kauf	USD	2.746	Verkauf	AUD	4.080	-158
13. März 2026	UBS	Kauf	USD	830	Verkauf	AUD	1.250	-60
16. März 2026	Citi	Kauf	NOK	9.100	Verkauf	USD	930	27
16. März 2026	HSBC	Kauf	USD	949	Verkauf	NOK	9.100	-8
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD	124	Verkauf	HUF	41.000	-4
19. März 2026	Barclays	Kauf	USD	447	Verkauf	COP	1.760.000	-19
19. März 2026	Barclays	Kauf	COP	50.000	Verkauf	USD	14	–
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD	10.612	Verkauf	GBP	7.910	-50
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	GBP	960	Verkauf	USD	1.291	4
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	GBP	1.970	Verkauf	USD	2.669	-14
21. Apr. 2026	Barclays	Kauf	USD	768	Verkauf	CAD	1.050	-3
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	303	Verkauf	CAD	410	1
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	CAD	1.540	Verkauf	USD	1.118	13
21. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD	59	Verkauf	CAD	80	–
24. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	875	Verkauf	JPY	133.000	19
24. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	JPY	90.000	Verkauf	USD	594	-14
27. Apr. 2026	HSBC	Kauf	CLP	200.000	Verkauf	USD	227	3
28. Apr. 2026	Citi	Kauf	KRW	1.630.000	Verkauf	USD	1.130	4
04. Mai. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	1.125	Verkauf	COP	4.210.000	22
08. Mai. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	3.172	Verkauf	EUR	2.670	6
08. Mai. 2026	UBS	Kauf	USD	47	Verkauf	EUR	40	–
11. Mai. 2026	Standard Chartered Bank	Kauf	USD	1.201	Verkauf	INR	109.000	10
13. Mai. 2026	Citi	Kauf	USD	1.068	Verkauf	MXN	18.500	1
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	839	Verkauf	MXN	14.600	-4
26. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	475	Verkauf	INR	43.500	–
26. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	NZD	1.080	Verkauf	USD	645	5
29. Mai. 2026	HSBC	Kauf	CLP	160.000	Verkauf	USD	186	-3
08. Jun. 2026	JP Morgan	Kauf	USD	878	Verkauf	CNH	6.000	-2
17. Jun. 2026	HSBC	Kauf	CLP	350.000	Verkauf	USD	403	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 515 \$)								\$ 136
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -154 \$)								-728
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 361 \$)								\$ -592

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 21,29 % (28. Februar 2025: 31,08 %)				USA – 21,52 % (28. Februar 2025: 9,65 %)				
274	Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R05, Series 2022 R05, Class 2B1, 144A, 8,167 %, fällig 25.04.2042 *	284	0,61	4.820	United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027 *	4.826	10,28	
439	Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R03, Series 2023 R03, Class 2M2, 144A, 7,567 %, fällig 25.04.2043 *	462	0,98	5.274	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027 *	5.281	11,24	
1.335	Fannie Mae REMICS, Series 2025 9, Class FC, 4,967 %, fällig 25.03.2055 *	1.350	2,87			10.107	21,52	
968	Freddie Mac REMICS 5470, Class FA, 4,767 %, fällig 25.11.2054 *	975	2,08	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 27.945 \$)				
828	Freddie Mac REMICS 5473, Class FN, 4,917 %, fällig 25.11.2054 *	835	1,78			29.143	62,05	
403	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M2, 144A, 8,917 %, fällig 25.05.2042 *	423	0,90	Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,71 % (28. Februar 2025: 3,06 %)				
607	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3, Series 2022 HQA3, Class M1B, 144A, 7,217 %, fällig 25.08.2042 *	631	1,34	1.275	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.275	2,71	
587	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA2, Series 2023 DNA2, Class M1B, 144A, 6,918 %, fällig 25.04.2043 *	612	1,30	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.275 \$)				
860	Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	879	1,87			1.275	2,71	
537	Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	549	1,17	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 44.921 \$)				
912	Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	933	1,99			45.786	97,49	
131	Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	134	0,29	Devisenterminkontrakte – 1,37 % (28. Februar 2025: 1,14 %)				
856	Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	875	1,86	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
1.050	MFI 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042 *	1.055	2,25	Futures – 0,24 % (28. Februar 2025: 0,08 %)				
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 9.926 \$)				Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)				
				110				0,24
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 9.926 \$)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte				
				46.538				99,10
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 11,44 % (28. Februar 2025: 20,24 %)				Devisenterminkontrakte – -1,23 % (28. Februar 2025: -1,50 %)				
Australien – 0,26 % (28. Februar 2025: 2,12 %)				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
151	IREN Ltd, 144A, Nullkupon, fällig 01.07.2031	120	0,26	Futures – -0,29 % (28. Februar 2025: -0,18 %)				
Kanada – 1,60 % (28. Februar 2025: 1,97 %)				Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)				
749	Toronto-Dominion Bank/The, 4,568 %, fällig 17.12.2026	753	1,60	-135				-0,29
USA – 9,58 % (28. Februar 2025: 13,85 %)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten				
285	Aircastle Ltd, 144A, 5,250 %, Ewige Anleihe *	285	0,61			-712	-1,52	
462	Ally Financial Inc, Series B, 4,700 %, Ewige Anleihe *	461	0,98	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten				
459	American Express Co, 3,550 %, Ewige Anleihe *	457	0,97			45.826	97,58	
548	Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, fällig 16.09.2027	559	1,19	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte				
231	Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	230	0,49			1.139	2,42	
802	General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	803	1,71	GesamtNettovermögen				
335	Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	314	0,67			46.965 \$	100,00	
350	NFE Financing LLC, 0,000 %, fällig 15.11.2029	127	0,27	– 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 %.				
177	Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	1	–					
7	Saks Global Enterprises LLC, Series 144*, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	–	–	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 3.873.000 \$ und machten 8,25 % des Nettovermögens aus.			
16	SGUS LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	–	–	*	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.			
855	Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	856	1,83	€	Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).			
405	Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	405	0,86					
		4.498	9,58	ABKÜRZUNGEN:				
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.775 \$)				Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.				
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 62,05 % (28. Februar 2025: 43,37 %)				REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit				
Australien – 6,28 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				AUD – Australischer Dollar				
AUD	4.300 Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	2.952	6,28	BRL – Brasilianischer Real				
Brasilien – 10,87 % (28. Februar 2025: 8,57 %)				COP – Kolumbianischer Peso				
BRL	14.735 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	2.470	5,26	EGP – Ägyptisches Pfund				
BRL	16.158 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2035	2.633	5,61	HUF – Ungarischer Forint				
		5.103	10,87	MXN – Mexikanischer Peso				
Kolumbien – 4,29 % (28. Februar 2025: 3,91 %)				Verteilung des Gesamtvermögens				
COP	590.000 Kolumbien, TES, Serie B, 13,250 %, fällig 09.02.2033	153	0,33	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden				
COP	730.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,750 %, fällig 24.01.2035	178	0,38	92,20				
COP	6.760.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	1.513	3,22	Organismen für gemeinsame Anlagen				
COP	730.000 Kolumbien, TES, Series B, 12,000 %, fällig 13.03.2058	171	0,36	Finanzderivate				
		2.015	4,29	1,56				
Ägypten – 10,00 % (28. Februar 2025: 6,88 %)				Sonstige Vermögenswerte				
EGP	42.700 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 21.04.2026	865	1,84	3,60				
EGP	202.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.08.2026	3.833	8,16	Gesamtvermögen				
		4.698	10,00	100,00				
Ungarn – 1,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)								
HUF	152.000 Ungarn, Staatsanleihe, Serie 35/A, 7,000 %, fällig 24.10.2035	497	1,06					
Mexiko – 8,03 % (28. Februar 2025: 7,09 %)								
MXN	7.000 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 11.07.2047	363	0,77					
MXN	57.000 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	2.932	6,24					
MXN	9.300 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 29.04.2055	476	1,02					
		3.771	8,03					

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	Barclays	Kauf	AUD 3.470	Verkauf	USD 2.393	\$ 77
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 1	Verkauf	GBP 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 276	Verkauf	USD 330	-3
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 116	Verkauf	USD 159	-3
13. März 2026	Citi	Kauf	AUD 2.070	Verkauf	USD 1.433	40
13. März 2026	HSBC	Kauf	USD 461	Verkauf	AUD 690	-30
16. März 2026	Citi	Kauf	USD 2.383	Verkauf	NOK 22.800	-15
16. März 2026	Citi	Kauf	NOK 46.700	Verkauf	USD 4.643	267
19. März 2026	Barclays	Kauf	USD 1.489	Verkauf	COP 5.860.000	-64
19. März 2026	Barclays	Kauf	COP 1.290.000	Verkauf	USD 349	-7
30. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	ZAR 22.700	Verkauf	USD 1.416	6
16. Apr. 2026	UBS	Kauf	USD 9.284	Verkauf	CHF 7.310	-275
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD 2.369	Verkauf	CAD 3.210	10
24. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	JPY 720.000	Verkauf	USD 4.743	-109
28. Apr. 2026	Citi	Kauf	KRW 1.370.000	Verkauf	USD 961	-8
28. Apr. 2026	Citi	Kauf	KRW 2.060.000	Verkauf	USD 1.432	1
06. Mai. 2026	Citi	Kauf	KRW 10.230.000	Verkauf	USD 7.091	25
06. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 1.421	Verkauf	SEK 12.750	4
08. Mai. 2026	JP Morgan	Kauf	USD 9.503	Verkauf	EUR 8.000	19
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 3.889	Verkauf	MXN 67.700	-17
19. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.391	Verkauf	CZK 49.100	-5
19. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	CZK 49.100	Verkauf	USD 2.396	–
26. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	NZD 1.980	Verkauf	USD 1.187	5
29. Mai. 2026	HSBC	Kauf	CLP 820.000	Verkauf	USD 953	-14
02. Jun. 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 1.866	Verkauf	EGP 95.700	-27
02. Jun. 2026	Morgan Stanley	Kauf	EGP 143.600	Verkauf	USD 2.652	188
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.531 \$)						\$ 642
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -2.008 \$)						-577
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -477 \$)						\$ 65

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
Australia 10 Year Bond März 2026	Morgan Stanley	85	\$ 6.688	\$ 40
Kanada, 10-jährige Anleihe, Juni 2026	Morgan Stanley	-71	-6.394	-23
Long Gilt Juni 2026	Morgan Stanley	48	6.060	70
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Morgan Stanley	-16	-1.821	-9
U.S. 10 Year Ultra Note Juni 2026	Morgan Stanley	-119	-13.891	-103
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 104 \$)				\$ 110
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -234 \$)				-135
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -130 \$)				\$ -25

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 91,87 % (28. Februar 2025: 91,39 %)					
Australien – 1,11 % (28. Februar 2025: 2,28 %)					
450 Coronado Finance Pty Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2029	418	0,60	300 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2030	291	0,42
350 Mineral Resources Ltd, 144A, 8,000 %, fällig 01.11.2027	358	0,51	400 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2033	375	0,54
	776	1,11	500 Cable One Inc, 1,125 %, fällig 15.03.2028	384	0,55
Brasilien – 0,73 % (28. Februar 2025: 1,72 %)					
255 Adecoagro SA, 144A, 7,500 %, fällig 29.07.2032	247	0,35	625 Carpenter Technology Corp, 144A, 5,625 %, fällig 01.03.2034	638	0,91
247 Yinson Bergronia Production BV, 144A, 8,498 %, fällig 31.01.2045	262	0,38	450 Centene Corp, 4,625 %, fällig 15.12.2029	439	0,63
	509	0,73	239 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	151	0,22
Kanada – 3,92 % (28. Februar 2025: 5,00 %)					
325 CI Financial Corp, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2029	347	0,50	100 Century Communities Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.09.2033	102	0,15
250 Enerflex Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.01.2031	259	0,37	600 Charles River Laboratories International Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.03.2029	578	0,83
305 goeasy Ltd, 144A, 4,375 %, fällig 01.05.2026	302	0,43	500 Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	499	0,71
1.056 Saturn Oil & Gas Inc, 144A, 9,625 %, fällig 15.06.2029	1.086	1,55	275 Chord Energy Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.10.2030	281	0,40
450 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	451	0,65	250 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.09.2031	261	0,37
300 Vermilion Energy Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2033	294	0,42	600 Cogent Communications Group LLC / Cogent Finance Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2032	532	0,76
	2.739	3,92	601 Coterra Energy Operating Co, 3,900 %, fällig 15.05.2027	597	0,86
Kolumbien – 0,51 % (28. Februar 2025: 0,81 %)					
475 Ecopetrol SA, 5,875 %, fällig 28.05.2045	358	0,51	505 Coterra Energy Operating Co, 4,375 %, fällig 15.03.2029	494	0,71
Dominikanische Republik – 0,30 % (28. Februar 2025: 0,47 %)					
200 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	211	0,30	725 Covista Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	725	1,04
Finnland – 0,39 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
250 Nokia Oyj, 6,625 %, fällig 15.05.2039	271	0,39	870 Credit Acceptance Corp, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2028	910	1,30
Deutschland – 1,35 % (28. Februar 2025: 4,11 %)					
525 Cerdia Finanz GmbH, 144A, 9,375 %, fällig 03.10.2031	538	0,77	246 DBR Land Holdings LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.12.2030	254	0,36
400 ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	405	0,58	700 Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	724	1,04
	943	1,35	125 Dream Finders Homes Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.09.2030	128	0,18
Irland – 1,13 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
450 Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	449	0,64	370 Elastic NV, 144A, 4,125 %, fällig 15.07.2029	350	0,50
GBP 250 Flutter Treasury DAC, 6,125 %, fällig 04.06.2031	339	0,49	270 Encore Capital Group Inc, 4,250 %, fällig 01.06.2028	355	0,51
	788	1,13	250 Encore Capital Group Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.04.2029	262	0,37
Japan – 0,30 % (28. Februar 2025: 1,15 %)					
200 Kioxia Holdings Corp, 144A, 6,250 %, fällig 24.07.2030	208	0,30	850 Enova International Inc, 144A, 11,250 %, fällig 15.12.2028	898	1,29
Puerto Rico – 0,63 % (28. Februar 2025: 0,59 %)					
625 LCPR Senior Secured Financing DAC, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2027	439	0,63	325 Enpro Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.06.2033	336	0,48
Schweiz – 1,09 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
735 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	764	1,09	350 Fair Isaac Corp, 144A, 4,000 %, fällig 15.06.2028	343	0,49
Trinidad und Tobago – 0,54 % (28. Februar 2025: 0,92 %)					
373 Port Of Spain Waterfront Development, 144A, 7,875 %, fällig 19.02.2040	380	0,54	425 Fair Isaac Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.05.2033	430	0,62
Vereinigtes Königreich – 3,69 % (28. Februar 2025: 5,29 %)					
EUR 600 Ardonagh Finco Ltd, 6,875 %, fällig 15.02.2031	720	1,03	1.225 FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	1.220	1,75
151 British Airways 2019-1 Class AA Pass Through Trust, 144A, 3,300 %, fällig 15.12.2032	144	0,21	165 Forestar Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2028	166	0,24
750 EG Global Finance Plc, 144A, 12,000 %, fällig 30.11.2028	807	1,16	700 Forestar Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.03.2033	717	1,03
700 Howden UK Refinance Plc / Howden UK Refinance 2 Plc / Howden US Refinance LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2031	710	1,02	350 Freedom Mortgage Corp, 144A, 6,625 %, fällig 15.01.2027	350	0,50
200 Howden UK Refinance Plc / Howden UK Refinance 2 Plc / Howden US Refinance LLC, 144A, 8,125 %, fällig 15.02.2032	192	0,27	160 Freedom Mortgage Holdings LLC, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2031	154	0,22
	2.573	3,69	850 Gap Inc/The, 144A, 3,875 %, fällig 01.10.2031	792	1,13
USA – 75,89 % (28. Februar 2025: 63,01 %)					
350 AAR Escrow Issuer LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2029	361	0,52	650 Go Daddy Operating Co LLC / GD Finance Co Inc, 144A, 5,250 %, fällig 01.12.2027	647	0,93
425 Acushnet Co, 144A, 5,625 %, fällig 01.12.2033	434	0,62	630 Graham Holdings Co, 144A, 5,625 %, fällig 01.12.2033	632	0,90
350 Adams Homes Inc, 144A, 9,250 %, fällig 15.10.2028	365	0,52	532 GrubHub Holdings Inc, 144A, 13,000 %, fällig 31.07.2030	358	0,51
910 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	558	0,80	350 HealthEquity Inc, 144A, 4,500 %, fällig 01.10.2029	341	0,49
600 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	606	0,87	410 Herc Holdings Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.03.2031	416	0,60
325 AllerTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2033	341	0,49	425 Installed Building Products Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.02.2034	432	0,62
425 Amkor Technology Inc, 144A, 5,875 %, fällig 01.10.2033	434	0,62	300 Insulet Corp, 144A, 6,500 %, fällig 01.04.2033	312	0,45
300 Amsted Industries Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.03.2033	313	0,45	1.000 IQVIA Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2026	1.001	1,43
650 ANGI Group LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2028	584	0,84	700 Jefferson Capital Holdings LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2029	740	1,06
475 Arko Corp, 144A, 5,125 %, fällig 15.11.2029	424	0,61	300 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650 %, Ewige Anleihe *	299	0,43
350 Atlanticus Holdings Corp, 144A, 9,750 %, fällig 01.09.2030	318	0,46	550 Kraken Oil & Gas Partners LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2029	558	0,80
500 Baldwin Insurance Group Holdings LLC / Baldwin Insurance Group Holdings Finance, 144A, 7,125 %, fällig 15.05.2031	502	0,72	123 Liberty Interactive LLC, 8,500 %, fällig 15.07.2029	5	0,01
425 BKV Upstream Midstream LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.10.2030	433	0,62	400 Lindblad Expeditions LLC, 144A, 7,000 %, fällig 15.09.2030	420	0,60
225 Block Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.08.2030	228	0,33	350 Live Nation Entertainment Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.05.2027	352	0,50
225 Block Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.08.2033	229	0,33	250 Macy's Retail Holdings LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2032	252	0,36
525 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	525	0,75	325 Magnera Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.11.2031	318	0,46
775 Brundage-Bone Concrete Pumping Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.02.2032	790	1,13	350 Magnolia Oil & Gas Operating LLC / Magnolia Oil & Gas Finance Corp, 144A, 6,875 %, fällig 01.12.2032	366	0,52
			640 Match Group Holdings II LLC, 144A, 5,000 %, fällig am 15.12.2027	640	0,92
			450 Match Group Holdings II LLC, 144A, 4,125 %, fällig 01.08.2030	428	0,61
			675 Mativ Holdings Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.10.2029	667	0,95
			350 Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, fällig 01.04.2029	344	0,49
			500 Midwest Gaming Borrower LLC / Midwest Gaming Finance Corp, 144A, 4,875 %, fällig 01.05.2029	492	0,70
			250 Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	257	0,37
			300 Millrose Properties Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.09.2032	304	0,44
			625 Molina Healthcare Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2033	615	0,88
			175 Murphy Oil Corp, 6,500 %, fällig 15.02.2034	175	0,25
			425 NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.01.2031	430	0,62
			825 Panther Escrow Issuer LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.06.2031	840	1,20

^ 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 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Sambia – 0,29 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
USA – (Fortsetzung)			200 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2036		
250 Phinia Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2029	259	0,37		201	0,29
460 PNC Financial Services Group Inc/The, Series T, 3,400 %, Ewige Anleihe *	455	0,65	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 65.480 \$)		
650 PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	601	0,86		64.155	91,87
900 PROG Holdings Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2029	884	1,27	Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,24 % (28. Februar 2025: 6,95 %)		
700 Provident Funding Associates LP / PFG Finance Corp, 144A, 9,750 %, fällig 15.09.2029	728	1,04	4.359 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)		
859 QVC Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	365	0,52		4.359	6,24
200 QVC Inc, 5,450 %, fällig 15.08.2034	86	0,12	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 4.359 \$)		
300 RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp, 4,750 %, fällig 15.10.2027	300	0,43		4.359	6,24
250 RHP Hotel Properties LP / RHP Finance Corp, 144A, 4,500 %, fällig 15.02.2029	247	0,35	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 69.839 \$)		
175 Rivers Enterprise Borrower LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.10.2030	179	0,26		68.514	98,11
600 ROBLOX Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.05.2030	573	0,82	Devisenterminkontrakte – 0,07 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
95 Rocket Mortgage LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.01.2028	93	0,13	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
1.050 Ryan Specialty LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2032	1.059	1,52		52	0,07
525 Sabre GBL Inc, 144A, 10,750 %, fällig 15.11.2029	383	0,55	Futures – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,05 %)		
175 Sabre GBL Inc, 144A, 11,125 %, fällig 15.07.2030	127	0,18	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
320 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	2	–		27	0,04
12 Saks Global Enterprises LLC, Series 144*, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	–	–	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
188 SGUS LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	5	0,01		68.593	98,22
455 SM Energy Co, 6,750 %, fällig 15.09.2026	456	0,65	Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2025: -0,54 %)		
128 SM Energy Co, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2026	128	0,18	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
200 SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	201	0,29		-8	-0,01
625 Snap Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.03.2034	623	0,89	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
425 Synergy Infrastructure Holdings LLC, 144A, 7,875 %, fällig 01.12.2030	444	0,64		-8	-0,01
350 TGNR Intermediate Holdings LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	346	0,50	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
350 Titan International Inc, 7,000 %, fällig 30.04.2028	352	0,50		68.585	98,21
550 TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 31.01.2034	555	0,79	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
1.300 TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	1.325	1,90		1.247	1,79
1.315 Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	1.319	1,89	Gesamt Nettovermögen		
170 Twilio Inc, 3,875 %, fällig 15.03.2031	160	0,23		69.832 \$	100,00
100 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	100	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 %.		
705 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2029	692	0,99	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 56.963.000 \$ und machten 81,57 % des Nettovermögens aus.		
460 Vail Resorts Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2030	468	0,67	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
85 Velocity Commercial Capital LLC, 144A, 9,375 %, fällig 15.02.2031	86	0,12	€ Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).		
375 Venture Global Calcasieu Pass LLC, 144A, 3,875 %, fällig 15.08.2029	360	0,51	ABKÜRZUNGEN:		
600 Viking Cruises Ltd, 144A, 9,125 %, fällig 15.07.2031	639	0,91	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum. Ewige Anleihen sind nicht rückkaufbar, sondern zahlen gleichbleibend Zinsen.		
150 Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.10.2033	153	0,22	EUR – Euro		
875 VOC Escrow Ltd, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	875	1,25	GBP – Britisches Pfund Sterling		
500 WBI Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.10.2030	510	0,73			
475 WESCO Distribution Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2028	479	0,69	Verteilung des Gesamtvermögens		
175 WESCO Distribution Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.04.2031	175	0,25	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
250 Western Alliance Bancorp, 3,000 %, fällig 15.06.2031 *	247	0,35	Organismen für gemeinsame Anlagen		
237 Winnebago Industries Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.07.2028	236	0,34	Finanzderivate		
125 XPLR Infrastructure Operating Partners LP, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2031	132	0,19	Sonstige Vermögenswerte		
625 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	399	0,57	Gesamtvermögen		
425 ZoomInfo Technologies LLC/ZoomInfo Finance Corp, 144A, 3,875 %, fällig 01.02.2029	367	0,53			
	52.995	75,89			

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)				
11. März 2026	BNY	Kauf	EUR	53	Verkauf	CAD	85	\$	–
11. März 2026	BNY	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	3		–
11. März 2026	BNY	Kauf	GBP	–	Verkauf	EUR	–		–
11. März 2026	BNY	Kauf	CAD	5.202	Verkauf	EUR	3.224		3
11. März 2026	BNY	Kauf	EUR	141	Verkauf	GBP	124		1
11. März 2026	BNY	Kauf	CAD	475	Verkauf	GBP	257		2
11. März 2026	BNY	Kauf	EUR	6.154	Verkauf	USD	7.266		9
11. März 2026	BNY	Kauf	CAD	20.685	Verkauf	USD	15.135		37
17. Apr. 2026	Wells Fargo Bank	Kauf	GBP	355	Verkauf	USD	478		–
08. Mai. 2026	JP Morgan	Kauf	EUR	10.760	Verkauf	USD	12.765		-8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1 \$)								\$	52
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -232 \$)									-8
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -231 \$)								\$	44

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
U.S. 10 Year Note (CBT) Juni 2026	Citi	38	\$ 4.325	\$ 27
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 23 \$)				\$ 27
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				–
Nettowertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 23 \$)				\$ 27

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 9,31 % (28. Februar 2025: 13,89 %)				610	United States Treasury Floating Rate Note, 3,742 %, fällig 31.01.2028 *	610	0,31
2.080	Fannie Mae Pool 'MA5421', 6,000 %, fällig 01.07.2054	2.136	1,07	8.790	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027 *	8.801	4,42
3.651	Fannie Mae Pool 'MA5445', 6,000 %, fällig 01.08.2054	3.749	1,88			60.578	30,41
2.737	Freddie Mac Pool 'SD8463', 6,000 %, fällig 01.09.2054	2.811	1,41	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 164.618 \$)			
3.238	Freddie Mac Pool 'SD8470', 6,000 %, fällig 01.10.2054	3.325	1,67			170.253	85,46
345	Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	352	0,18	Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,08 % (28. Februar 2025: 3,10 %)			
1.225	Ginnie Mae II Pool 'MA9363', 6,000 %, fällig 20.12.2053	1.255	0,63	6.138	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	6.138	3,08
107	Ginnie Mae II Pool 'MA9606', 6,000 %, fällig 20.04.2054	110	0,06	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 6.138 \$)			
171	Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	175	0,09			6.138	3,08
212	Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	217	0,11	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 195.004 \$)			
2.599	Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	2.658	1,33			200.976	100,88
151	Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	155	0,08	Devisenterminkontrakte – 0,90 % (28. Februar 2025: 0,67 %)			
1.433	Ginnie Mae II Pool 'MB0026', 5,500 %, fällig 20.11.2054	1.456	0,73		Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.790	0,90
141	Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	145	0,07	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte			
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 18.135 \$)						202.766	101,78
		18.544	9,31	Devisenterminkontrakte – -0,81 % (28. Februar 2025: -1,06 %)			
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 3,03 % (28. Februar 2025: 3,20 %)					Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.616	-0,81
Supranational – 3,03 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten			
INR	98.500 Corp Andina de Fomento, 144A, 7,250 %, fällig 06.03.2036	1.063	0,53			-1.616	-0,81
INR	458.000 Inter-American Development Bank, 6,850 %, fällig 18.02.2036	4.978	2,50	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten			
		6.041	3,03			201.150	100,97
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 6.113 \$)				Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten			
		6.041	3,03			-1.923	-0,97
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 85,46 % (28. Februar 2025: 79,66 %)				Gesamtvermögen			
Australien – 12,50 % (28. Februar 2025: 4,82 %)						199.227 \$	100,00
AUD	17.640 Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	12.108	6,08	–			
AUD	5.360 New South Wales Treasury Corp, 4,250 %, fällig 20.02.2036	3.538	1,78	Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.			
AUD	7.780 Queensland Treasury Corp, 144A, 5,250 %, fällig 21.07.2036	5.529	2,77	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.670.000 \$ und machten 3,84 % des Nettovermögens aus.			
AUD	5.480 Treasury Corp of Victoria, 4,750 %, fällig 15.09.2036	3.726	1,87	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.			
		24.901	12,50	ABKÜRZUNGEN:			
Brasilien – 9,16 % (28. Februar 2025: 3,87 %)				AUD	– Australischer Dollar		
BRL	24.560 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	4.117	2,06	BRL	– Brasilianischer Real		
BRL	86.750 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN-F, 10,000 %, fällig 01.01.2035	14.139	7,10	COP	– Kolumbianischer Peso		
		18.256	9,16	EGP	– Ägyptisches Pfund		
Kolumbien – 4,21 % (28. Februar 2025: 0,54 %)				GBP	– Britisches Pfund Sterling		
COP	2.440.000 Kolumbien, TES, Serie B, 13,250 %, fällig 09.02.2033	632	0,32	HUF	– Ungarischer Forint		
COP	2.970.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,750 %, fällig 24.01.2035	725	0,36	INR	– Indische Rupie		
COP	28.300.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	6.334	3,18	JPY	– Japanischer Yen		
COP	2.970.000 Kolumbien, TES, Series B, 12,000 %, fällig 13.03.2058	697	0,35	MXN	– Mexikanischer Peso		
		8.388	4,21	Verteilung des Gesamtvermögens			
Ägypten – 5,14 % (28. Februar 2025: 4,66 %)				% des Gesamtvermögens			
EGP	155.900 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 21.04.2026	3.157	1,58	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden			
EGP	154.800 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 18.08.2026	2.925	1,47	Organismen für gemeinsame Anlagen			
EGP	227.700 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 20.10.2026	4.160	2,09	Finanzderivate			
		10.242	5,14	Sonstige Vermögenswerte			
Ungarn – 1,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				Gesamtvermögen			
HUF	623.000 Ungarn, Staatsanleihe, Serie 35/A, 7,000 %, fällig 24.10.2035	2.038	1,02			100,00	
Japan – 3,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)							
JPY	494.000 Japan, 40-jährige Staatsanleihe, Serie 18, 3,100 %, fällig 20.03.2065	2.929	1,47				
JPY	487.000 Japan, 30-jährige Staatsanleihe, Serie 89, 3,400 %, fällig 20.12.2055	3.155	1,58				
		6.084	3,05				
Mexiko – 6,67 % (28. Februar 2025: 10,08 %)							
MXN	72.800 Mexikanische Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 07.11.2047	3.774	1,90				
MXN	137.500 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	7.073	3,55				
MXN	47.500 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 29.04.2055	2.431	1,22				
		13.278	6,67				
Norwegen – 0,54 % (28. Februar 2025: 0,00 %)							
INR	100.000 Kommunalbanken AS, 144A, 7,000 %, fällig 05.03.2036	1.078	0,54				
Vereinigtes Königreich – 12,76 % (28. Februar 2025: 16,86 %)							
GBP	9.120 Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	12.535	6,29				
GBP	2.070 United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	1.281	0,65				
GBP	9.560 United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	11.594	5,82				
		25.410	12,76				
USA – 30,41 % (28. Februar 2025: 26,79 %)							
	22.620 United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027 *	22.649	11,37				
	28.470 United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027 *	28.518	14,31				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
03. März 2026	JP Morgan	Kauf	USD 6.876	Verkauf	CNH 47.280	\$ -15	
03. März 2026	JP Morgan	Kauf	CNH 47.280	Verkauf	USD 6.793	98	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 314	Verkauf	AUD 270	-5	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 512	Verkauf	CAD 419	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 2.875	Verkauf	CNY 11.944	-14	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 50	Verkauf	DKK 190	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 7.176	Verkauf	EUR 3.638	5	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 1.414	Verkauf	GBP 625	5	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 101	Verkauf	ILS 187	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 2.293	Verkauf	JPY 214.721	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 227	Verkauf	MXN 2.374	-2	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 42	Verkauf	NOK 248	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	JPY 687	Verkauf	NZD 7	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	USD 21	Verkauf	NZD 35	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	PLN 1	Verkauf	NZD 1	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	SEK 1	Verkauf	NZD –	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	SGD –	Verkauf	NZD –	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	ILS 1	Verkauf	NZD –	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	GBP 2	Verkauf	NZD 5	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	EUR 12	Verkauf	NZD 23	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	DKK 1	Verkauf	NZD –	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	CNY 39	Verkauf	NZD 9	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	CAD 1	Verkauf	NZD 2	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	AUD 1	Verkauf	NZD 1	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NOK 1	Verkauf	NZD –	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	MXN 8	Verkauf	NZD 1	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 179	Verkauf	PLN 384	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 45	Verkauf	SEK 242	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 92	Verkauf	SGD 70	–	
11. März 2026	BNY	Kauf	NZD 10.863	Verkauf	USD 6.499	21	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 11	Verkauf	GBP 8	–	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 5	Verkauf	USD 6	–	
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 269	Verkauf	USD 368	-5	
13. März 2026	Citi	Kauf	AUD 8.500	Verkauf	USD 5.884	165	
13. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 7.567	Verkauf	AUD 11.180	-389	
13. März 2026	HSBC	Kauf	USD 2.608	Verkauf	AUD 3.880	-153	
13. März 2026	UBS	Kauf	AUD 3.350	Verkauf	USD 2.224	160	
16. März 2026	Citi	Kauf	NOK 57.800	Verkauf	USD 5.744	335	
19. März 2026	Barclays	Kauf	USD 6.099	Verkauf	COP 24.000.000	-265	
19. März 2026	Barclays	Kauf	COP 5.170.000	Verkauf	USD 1.400	-29	
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD 39.187	Verkauf	GBP 29.200	-171	
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	GBP 7.290	Verkauf	USD 9.877	-51	
17. Apr. 2026	HSBC	Kauf	GBP 3.800	Verkauf	USD 5.110	13	
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD 3.775	Verkauf	CAD 5.200	-45	
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD 5.158	Verkauf	CAD 6.990	22	
21. Apr. 2026	Citi	Kauf	CAD 18.840	Verkauf	USD 13.680	163	
24. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	JPY 2.108.000	Verkauf	USD 13.892	-326	
24. Apr. 2026	JP Morgan	Kauf	JPY 2.636.000	Verkauf	USD 16.823	141	
27. Apr. 2026	HSBC	Kauf	CLP 5.480.000	Verkauf	USD 6.211	67	
28. Apr. 2026	Citi	Kauf	KRW 21.860.000	Verkauf	USD 14.989	215	
06. Mai. 2026	Citi	Kauf	KRW 17.860.000	Verkauf	USD 12.372	53	
11. Mai. 2026	Standard Chartered Bank	Kauf	USD 4.682	Verkauf	INR 425.000	38	
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 13.085	Verkauf	MXN 227.800	-57	
26. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 2.168	Verkauf	INR 198.500	2	
26. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	NZD 9.240	Verkauf	USD 5.516	44	
29. Mai. 2026	HSBC	Kauf	CLP 3.500.000	Verkauf	USD 4.068	-58	
02. Jun. 2026	Morgan Stanley	Kauf	EGP 173.300	Verkauf	USD 3.201	227	
08. Jun. 2026	JP Morgan	Kauf	CNH 47.000	Verkauf	USD 6.877	16	
17. Jun. 2026	HSBC	Kauf	CLP 5.580.000	Verkauf	USD 6.422	-31	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.206 \$)						\$	1.790
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.908 \$)							-1.616
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -702 \$)						\$	174

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,64 % (28. Februar 2025: 0,52 %)					
4.590 Bellemeade Re 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M1B, 144A, 7,917 %, fällig 25.10.2033 *	4.708	0,64	1.704 Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	1.742	0,24
			6.510 MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042 *	6.538	0,89
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 4.743 \$)	4.708	0,64	Summe hypotheckenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 172.401 \$)	170.477	23,14
Hypotheckenbesicherte Wertpapiere – 23,14 % (28. Februar 2025: 16,88 %)			Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 48,21 % (28. Februar 2025: 59,03 %)		
142 Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R07, Series 2019 R07, Class 1B1, 144A, 7,182 %, fällig 25.10.2039 *	144	0,02	Argentinien – 2,43 % (28. Februar 2025: 1,71 %)		
11.610 Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 1M2, 144A, 7,432 %, fällig 25.02.2040 *	11.924	1,62	1.610 Pluspetrol SA, 144A, 8,125 %, fällig 18.05.2031	1.647	0,22
5.930 Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R02, Series 2021 R02, Class 2B1, 144A, 6,967 %, fällig 25.11.2041 *	6.027	0,82	3.600 Transportadora de Gas del Sur SA, 144A, 8,500 %, fällig 24.07.2031	3.803	0,52
9.200 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1B1, 144A, 8,917 %, fällig 25.03.2042 *	9.596	1,30	1.800 YPF Energia Electrica SA, 144A, 7,875 %, fällig 16.10.2032	1.849	0,25
556 Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R05, Series 2022 R05, Class 2B1, 144A, 8,167 %, fällig 25.04.2042 *	577	0,08	5.610 YPF SA, 144A, 9,500 %, fällig 17.01.2031	5.969	0,81
4.300 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R02, Series 2023 R02, Class 1B1, 144A, 9,217 %, fällig 25.01.2043 *	4.609	0,63	4.530 YPF SA, 144A, 8,250 %, fällig 17.01.2034	4.659	0,63
891 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R03, Series 2023 R03, Class 2M2, 144A, 7,567 %, fällig 25.04.2043 *	938	0,13		17.927	2,43
410 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Series 2023 R07, Class 2B1, 144A, 8,167 %, fällig 25.09.2043 *	439	0,06	Australien – 1,60 % (28. Februar 2025: 1,20 %)		
5.570 Connecticut Avenue Securities Trust 2023-R07, Series 2023 R07, Class 2M2, 144A, 6,917 %, fällig 25.09.2043 *	5.762	0,78	3.176 IREN Ltd, 144A, Nullkupon, fällig 01.07.2031	2.513	0,34
232 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R01, Series 2024 R01, Class 1M1, 144A, 4,717 %, fällig 25.01.2044 *	232	0,03	8.865 Mineral Resources Ltd, 144A, 9,250 %, fällig 01.10.2028	9.293	1,26
3.500 Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R05, Series 2024 R05, Class 2M2, 144A, 5,367 %, fällig 25.07.2044 *	3.509	0,48		11.806	1,60
1.950 Connecticut Avenue Securities Trust 2025-R06, Series 2025 R06, Class 1B1, 144A, 5,517 %, fällig 25.09.2045 *	1.980	0,27	Brasilien – 2,67 % (28. Februar 2025: 4,03 %)		
137 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C02, Class 2M2C, 7,432 %, fällig 25.09.2029 *	141	0,02	810 Adecoagro SA, 144A, 7,500 %, fällig 29.07.2032	785	0,11
26 Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2017 C06, Class 2M2, 6,582 %, fällig 25.02.2030 *	26	–	1.450 Azul Secured Finance LLP, 144A, 9,875 %, fällig 15.02.2031	1.461	0,20
2.657 Fannie Mae REMICS, Series 2025 9, Class FC, 4,967 %, fällig 25.03.2055 *	2.687	0,36	1.060 CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig 05.12.2030	862	0,12
1.927 Freddie Mac REMICS 5470, Class FA, 4,767 %, fällig 25.11.2054 *	1.940	0,26	5.423 ERO Copper Corp, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030	5.496	0,74
1.649 Freddie Mac REMICS 5473, Class FN, 4,917 %, fällig 25.11.2054 *	1.664	0,23	2.570 PRIO Luxembourg Holding Sarl, 144A, 6,750 %, fällig 15.10.2030	2.536	0,34
3.875 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2020-HQA5, Series 2020 HQA5, Class B1, 144A, 7,667 %, fällig 25.11.2050 *	4.271	0,58	1.820 Samarco Mineracao SA, 144A, 9,500 %, fällig 30.06.2031	1.827	0,25
1.500 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA2, Series 2021 HQA2, Class B1, 144A, 6,817 %, fällig 25.12.2033 *	1.677	0,23	6.072 Yinson Boronia Production BV, 8,947 %, fällig 31.07.2042	6.700	0,91
2.420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class M2, 144A, 7,417 %, fällig 25.02.2042 *	2.480	0,34		19.667	2,67
4.720 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA3, Series 2022 DNA3, Class M1B, 144A, 6,567 %, fällig 25.04.2042 *	4.820	0,65	Kanada – 2,35 % (28. Februar 2025: 4,73 %)		
2.780 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M1B, 144A, 7,017 %, fällig 25.05.2042 *	2.860	0,39	2.956 Air Canada 2015-1 Class A Pass Through Trust, 144A, 3,600 %, fällig 15.03.2027	2.929	0,39
13.452 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4, Series 2022 DNA4, Class M2, 144A, 8,917 %, fällig 25.05.2042 *	14.130	1,92	6.090 Antares Holdings LP, 144A, 2,750 %, fällig 15.01.2027	5.972	0,81
7.420 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M1B, 144A, 8,167 %, fällig 25.06.2042 *	7.757	1,05	6.890 Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	6.907	0,94
15.400 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5, Series 2022 DNA5, Class M2, 144A, 10,417 %, fällig 25.06.2042 *	16.493	2,24	1.521 Toronto-Dominion Bank/The, 4,568 %, fällig 17.12.2026	1.530	0,21
10.155 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6, Series 2022 DNA6, Class M2, 144A, 9,417 %, fällig 25.09.2042 *	10.862	1,47		17.338	2,35
2.501 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA7, Series 2022 DNA7, Class M1B, 144A, 8,667 %, fällig 25.03.2052 *	2.652	0,36	Chile – 1,43 % (28. Februar 2025: 1,12 %)		
7.822 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1, Series 2022 HQA1, Class B1, 144A, 10,667 %, fällig 25.03.2042 *	8.291	1,12	2.940 ATP Tower Holdings / Andean Telecom Partners Chile SpA / Andean Tower Partners C, 144A, 7,875 %, fällig 03.02.2030	3.038	0,41
2.870 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA2, Series 2022 HQA2, Class M2, 144A, 9,667 %, fällig 25.07.2042 *	3.062	0,41	2.720 ATP Tower Holdings LLC / Andean Tower Partners Colombia SAS / Andean Telecom Par, 4,050 %, fällig 27.04.2026	2.686	0,37
5.443 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA3, Series 2022 HQA3, Class M1B, 144A, 7,217 %, fällig 25.08.2042 *	5.653	0,77	4.570 Latam Airlines Group SA, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2030	4.770	0,65
1.193 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-DNA2, Series 2023 DNA2, Class M1B, 144A, 6,918 %, fällig 25.04.2043 *	1.243	0,17		10.494	1,43
166 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA1, Series 2023 HQA1, Class M1A, 144A, 5,667 %, fällig 25.05.2043 *	167	0,02	Kolumbien – 1,42 % (28. Februar 2025: 1,14 %)		
18 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA2, Series 2023 HQA2, Class M1A, 144A, 5,667 %, fällig 25.06.2043 *	18	–	3.540 Ecopetrol SA, 7,750 %, fällig 01.02.2032	3.615	0,49
5.400 Freddie Mac STACR REMIC Trust 2023-HQA3, Series 2023 HQA3, Class M2, 144A, 7,017 %, fällig 25.11.2043 *	5.674	0,77	3.230 Ecopetrol SA, 8,875 %, fällig 13.01.2033	3.430	0,47
12.589 Freddie Mac STACR Trust 2018-HQA2, Series 2018 HQA2, Class M2B, 144A, 6,082 %, fällig 25.10.2048 *	12.923	1,75	3.560 Geopark Ltd, 144A, 8,750 %, fällig 31.01.2030	3.387	0,46
1.712 Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	1.751	0,24		10.432	1,42
1.069 Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	1.093	0,15	Dominikanische Republik – 0,32 % (28. Februar 2025: 0,25 %)		
1.817 Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	1.858	0,25	2.260 Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA, 144A, 7,000 %, fällig 30.06.2034	2.389	0,32
261 Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	267	0,04	Griechenland – 0,43 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			3.060 Danaos Corp, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2032	3.158	0,43
			Irland – 0,33 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			2.460 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,200 %, fällig 15.04.2029	2.454	0,33
			Israel – 0,95 % (28. Februar 2025: 2,21 %)		
			4.970 Energean Israel Finance Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 30.03.2028	4.916	0,67
			1.995 Leviathan Bond Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 30.06.2030	2.058	0,28
				6.974	0,95
			Japan – 0,10 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
			730 Kioxia Holdings Corp, 144A, 6,250 %, fällig 24.07.2030	759	0,10
			Mexiko – 2,02 % (28. Februar 2025: 1,73 %)		
			3.227 Banco Mercantil del Norte SA/Grand Cayman, 144A, 5,875 %, Ewige Anleihe *	3.225	0,44
			1.350 Cemex SAB de CV, 144A, 7,200 %, Ewige Anleihe *	1.423	0,19
			3.612 Grupo Aeromexico SAB de CV, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2029	3.707	0,50
			2.111 Trust 2401, 144A, 4,869 %, fällig 15.01.2030	2.089	0,28
			1.029 Trust 2401, 144A, 7,700 %, fällig 23.01.2032	1.137	0,15
			1.089 Trust Fibra Uno, 4,869 %, fällig 15.01.2030	1.073	0,15
			2.051 Trust Fibra Uno, 144A, 7,700 %, fällig 23.01.2032	2.245	0,31
				14.899	2,02
			Panama – 0,54 % (28. Februar 2025: 0,41 %)		
			4.154 AES Panama Generation Holdings SRL, 4,375 %, fällig 31.05.2030	3.958	0,54

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)					
Peru – 0,28 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
2.020 Banco de Credito del Peru S.A., 144A, 5,650 %, fällig 15.01.2037 *	2.037	0,28	265 PNC Financial Services Group Inc/The, Series T, 3,400 %, Ewige Anleihe *	262	0,04
			7.640 PRA Group Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.10.2029	7.058	0,96
			3.805 Prime Healthcare Services Inc, 144A, 9,375 %, fällig 01.09.2029	3.977	0,54
Schweiz – 0,63 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
4.452 Allwyn Entertainment Financing UK Plc, 144A, 7,875 %, fällig 30.04.2029	4.627	0,63	4.383 Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	27	–
			164 Saks Global Enterprises LLC, Series 144 *, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	–	–
Vereinigtes Königreich – 1,24 % (28. Februar 2025: 1,22 %)					
1.630 Avianca Midco 2 Plc, 144A, 9,625 %, fällig 14.02.2030	1.648	0,22	7.172 Sempra, 4,125 %, fällig 01.04.2052 *	7.084	0,96
800 Avianca Midco 2 Plc, 144A, 9,500 %, fällig 28.01.2031	810	0,11	2.263 SGUS LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029 €	62	0,01
2.470 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	2.624	0,36	3.785 SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	3.795	0,51
GBP 1.075 Nationwide Building Society, 5,750 %, Ewige Anleihe *	1.462	0,20	3.460 Star Parent Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.10.2030	3.516	0,48
2.900 Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 4,750 %, fällig 15.07.2031	2.585	0,35	1.480 Synchrony Financial, 4,947 %, fällig 25.02.2032 *	1.472	0,20
	9.129	1,24	1.970 Texas Capital Bancshares Inc, 5,301 %, fällig 27.02.2032 *	1.977	0,27
			1.735 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	1.737	0,24
USA – 28,70 % (28. Februar 2025: 35,68 %)					
10.900 Affinity Interactive, 144A, 6,875 %, fällig 15.12.2027	6.682	0,91	9.440 United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.06.2027	9.406	1,28
7.622 Aircastle Ltd, 144A, 5,250 %, Ewige Anleihe *	7.623	1,03	1.080 Velocity Commercial Capital LLC, 144A, 9,375 %, fällig 15.02.2031	1.096	0,15
4.418 Allegiant Travel Co, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2027	4.463	0,61	4.140 Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe *	3.624	0,49
8.105 Ally Financial Inc, Series C, 4,700 %, Ewige Anleihe *	7.667	1,04	8.250 Viasat Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.04.2027	8.241	1,12
7.403 Ally Financial Inc, Series B, 4,700 %, Ewige Anleihe *	7.389	1,00	821 Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	821	0,11
2.497 American Express Co, 3,550 %, Ewige Anleihe *	2.483	0,34	4.365 ZipRecruiter Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2030	2.790	0,38
1.140 AmeriTex HoldCo Intermediate LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2033	1.194	0,16		211.385	28,70
2.240 Bank of New York Mellon Corp/The, Series I, 3,750 %, Ewige Anleihe *	2.208	0,30	Sambia – 0,77 % (28. Februar 2025: 1,78 %)		
1.700 Block Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.08.2033	1.729	0,23	5.376 First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	5.641	0,77
1.112 Blue Owl Credit Income Corp, 7,750 %, fällig 16.09.2027	1.134	0,15	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 354.719 \$)		
1.590 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2033	1.489	0,20		355.074	48,21
1.320 Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2034	1.295	0,18	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 20,44 % (28. Februar 2025: 16,50 %)		
1.786 Central Parent Inc / CDK Global Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.06.2029	1.130	0,15	Argentinien – 2,16 % (28. Februar 2025: 1,03 %)		
7.669 Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	7.648	1,04	8.856 Argentinische Republik, Internationale Staatsanleihe, 0,750 %, fällig 09.07.2030	7.528	1,03
4.210 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,750 %, fällig 01.04.2048	3.670	0,50	9.560 Internationale Anleihe der Argentinischen Republik, 4,125 %, fällig 09.07.2035	7.230	0,98
2.040 Citigroup Inc, Series Y, 4,150 %, Ewige Anleihe *	2.036	0,28	1.130 Provincia de Entre Rios Argentina, 144A, 9,550 %, fällig 04.03.2033	1.109	0,15
8.830 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2032	8.979	1,22		15.867	2,16
3.700 Cogent Communications Group LLC / Cogent Finance Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2032	3.283	0,45	Brasilien – 6,32 % (28. Februar 2025: 1,93 %)		
265 Credit Acceptance Corp, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2028	277	0,04	BRL 189.275 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2033	31.726	4,31
5.803 EchoStar Corp, 3,875 %, fällig 30.11.2030	20.513	2,78	BRL 90.740 Brasilien Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTNf, 10,000 %, fällig 01.01.2035	14.789	2,01
2.242 Embecta Corp, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2030	2.109	0,29		46.515	6,32
5.225 Energy Transfer LP, Series H, 6,500 %, Ewige Anleihe *	5.252	0,71	Kolumbien – 1,62 % (28. Februar 2025: 0,28 %)		
3.060 Enova International Inc, 144A, 9,125 %, fällig 01.08.2029	3.217	0,44	COP 9.700.000 Kolumbien, TES, Serie B, 13,250 %, fällig 09.02.2033	2.510	0,34
2.795 Enviri Corp, 144A, 5,750 %, fällig 31.07.2027	2.799	0,38	COP 42.120.000 Kolumbien, TES, Series B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	9.428	1,28
2.470 First Citizens BancShares Inc/NC, 4,869 %, fällig 03.03.2032 *	2.464	0,33		11.938	1,62
1.690 Freedom Mortgage Holdings LLC, 144A, 6,875 %, fällig 01.05.2031	1.631	0,22	Ecuador – 0,30 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
1.950 Freedom Mortgage Holdings LLC, 144A, 8,375 %, fällig 01.04.2032	1.966	0,27	2.220 Ecuador, Internationale Staatsanleihe, 144A, 8,750 %, fällig 29.01.2034	2.240	0,30
3.800 FS KKR Capital Corp, 3,125 %, fällig 12.10.2028	3.461	0,47	Ägypten – 3,60 % (28. Februar 2025: 2,82 %)		
1.628 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 04.06.2026	1.630	0,22	2.710 Ägypten, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,625 %, fällig 29.05.2032	2.797	0,38
1.955 Genesis Energy LP / Genesis Energy Finance Corp, 8,000 %, fällig 15.05.2033	2.068	0,28	1.370 Ägypten, Internationale Staatsanleihe, 144A, 9,450 %, fällig 04.02.2033	1.544	0,21
2.180 Getty Images Inc, 144A, 10,500 %, fällig 15.11.2030	1.931	0,26	EGP 193.900 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 14.04.2026	3.945	0,54
4.770 Global Payments Inc, 1,500 %, fällig 01.03.2031	4.348	0,59	EGP 103.000 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 21.04.2026	2.086	0,28
2.200 Goldman Sachs Private Credit Corp, 144A, 5,050 %, fällig 23.02.2028	2.187	0,30	EGP 800.750 Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 28.04.2026	16.147	2,19
680 Jabil Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2031	638	0,09		26.519	3,60
2.725 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650 %, Ewige Anleihe *	2.717	0,37	Mexiko – 6,44 % (28. Februar 2025: 5,96 %)		
2.790 Kraken Oil & Gas Partners LLC, 144A, 7,625 %, fällig 15.08.2029	2.831	0,38	MXN 90.500 Mexikanische Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig 26.05.2033	5.016	0,68
870 Level 3 Financing Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.01.2036	907	0,12	MXN 65.700 Mexiko, Bonos, Serie MS, 8,000 %, fällig 24.05.2035	3.662	0,50
1.070 Marriott Ownership Resorts Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.10.2033	1.038	0,14	MXN 753.600 Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	38.765	5,26
2.873 Murphy Oil Corp, 6,500 %, fällig 15.02.2034	2.875	0,39		47.443	6,44
501 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2082 *	496	0,07	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 143.029 \$)		
844 NFE Financing Brazil Ltd, 15,000 %, fällig 30.08.2029 t=	844	0,11		150.522	20,44
15.511 NFE Financing LLC, 0,000 %, fällig 15.11.2029	5.617	0,76	Schuldscheindarlehen – 0,80 % (28. Februar 2025: 1,11 %)		
1.260 PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 144A, 9,875 %, fällig 15.03.2030	1.338	0,18	2.733 Connect Finco S.a.r.l., 0,000 %, fällig 28.09.2029 *	2.735	0,37
2.270 Permian Resources Operating LLC, 144A, 8,000 %, fällig 15.04.2027	2.290	0,31	3.242 Star Parent Inc, 7,672 %, fällig 19.09.2030 *	3.148	0,43
2.260 Permian Resources Operating LLC, 144A, 6,250 %, fällig 01.02.2033	2.341	0,32		5.883	0,80
2.530 PNC Financial Services Group Inc/The, Series S, 5,000 %, Ewige Anleihe *	2.553	0,35	Summe Schuldscheindarlehen (Anschaffungskosten 5.937 \$)		
			Organismen für gemeinsame Anlagen – 6,81 % (28. Februar 2025: 3,38 %)		
			50.159 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	50.159	6,81
			Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 50.159 \$)		
				50.159	6,81
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 730.988 \$)		
				736.823	100,04

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Credit Default Swaps – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	123	0,02
Devisenterminkontrakte – 0,04 % (28. Februar 2025: 0,40 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	293	0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	737.239	100,10
Devisenterminkontrakte – -0,34 % (28. Februar 2025: -0,37 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-2.467	-0,34
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-2.467	-0,34
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	734.772	99,76
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.746	0,24
Gesamtnettovermögen	736.518 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 393.467.000 \$ und machten 53,40 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.
- † Nicht liquide.
- ∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.
- ⋈ Das Wertpapier ist zum 28. Februar 2026 in Verzug (Tilgungs- und/oder Zinszahlungen).

Aufstellung der Credit Default Swaps

Gegenpartei	Referenzschuldner – Kauf/Verkauf Schutz	Fälligkeitsdatum	Nominalbetrag (in Tsd.)	Wert (in Tsd.)
Barclays	Panama, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	7.140	\$ 62
JP Morgan	Panama, 1,000 % – Verkauf	20. Dez. 2028	7.020	61
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ 123
Nicht realisierte Wertminderung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -239 \$)				–
Nettowertsteigerung aus Credit Default Swaps (28. Februar 2025 (in Tsd.): -239 \$)				\$ 123

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

								Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)				
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	1.216	Verkauf	EUR	1.024	\$	5
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	899	Verkauf	EUR	762		-
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	21	Verkauf	GBP	15		-
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	SEK	10		-
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	374	Verkauf	SGD	475		-
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	322	Verkauf	SGD	405		1
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	891	Verkauf	USD	1.052		2
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	5.534	Verkauf	USD	7.571		-112
13. März 2026	BNY	Kauf	SEK	27.230	Verkauf	USD	3.057		-39
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	140	Verkauf	USD	110		-
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	50.423	Verkauf	USD	39.936		-34
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	5.632	Verkauf	USD	3.993		15
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH	6.569	Verkauf	USD	952		7
13. März 2026	BNY	Kauf	CZK	19.248	Verkauf	USD	946		-8
13. März 2026	BNY	Kauf	CZK	288	Verkauf	USD	14		-
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	138.022	Verkauf	USD	164.676		-1.482
19. März 2026	Barclays	Kauf	USD	5.785	Verkauf	COP	22.760.000		-251
19. März 2026	Barclays	Kauf	COP	22.760.000	Verkauf	USD	6.162		-127
13. Mai. 2026	Citi	Kauf	USD	26.730	Verkauf	MXN	462.800		32
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	20.432	Verkauf	MXN	355.700		-88
29. Mai. 2026	HSBC	Kauf	CLP	18.890.000	Verkauf	USD	21.954		-315
02. Jun. 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD	1.314	Verkauf	EGP	67.000		-11
02. Jun. 2026	Morgan Stanley	Kauf	EGP	808.000	Verkauf	USD	15.751		231
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 3.659 \$)								\$	293
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -3.340 \$)									-2.467
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 319 \$)								\$	-2.174

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	% des Gesamtvermögens
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 15,34 % (28. Februar 2025: 37,27 %)			
825 Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	843	2,39	
819 Ginnie Mae II Pool 'MA9306', 6,000 %, fällig 20.11.2053	844	2,39	
242 Ginnie Mae II Pool 'MA9606', 6,000 %, fällig 20.04.2054	248	0,70	
841 Ginnie Mae II Pool 'MA9669', 6,000 %, fällig 20.05.2054	860	2,44	
433 Ginnie Mae II Pool 'MA9726', 6,000 %, fällig 20.06.2054	444	1,26	
582 Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	596	1,69	
732 Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	749	2,12	
809 Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	828	2,35	
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 5.337 \$)	5.412	15,34	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 7,68 % (28. Februar 2025: 8,84 %)			
Schweiz – 1,50 % (28. Februar 2025: 0,53 %)			
330 UBS Group AG, 5,125 %, Ewige Anleihe *	330	0,93	
200 UBS Group AG, 144A, 3,875 %, Ewige Anleihe *	200	0,57	
	530	1,50	
USA – 6,18 % (28. Februar 2025: 6,71 %)			
55 American Express Co, 3,550 %, Ewige Anleihe *	55	0,15	
40 Ares Capital Corp, 7,000 %, fällig 15.01.2027	41	0,12	
100 Ares Capital Corp, 2,875 %, fällig 15.06.2028	95	0,27	
120 Blue Owl Capital Corp, 2,875 %, fällig 11.06.2028	112	0,32	
115 Boeing Co/The, 3,200 %, fällig 01.03.2029	112	0,32	
395 Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe *	394	1,12	
50 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 4,200 %, fällig 15.03.2028	50	0,14	
130 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,100 %, fällig 01.06.2029	136	0,39	
250 Golub Capital BDC Inc, 2,500 %, fällig 24.08.2026	247	0,70	
620 Toyota Motor Credit Corp, 4,450 %, fällig 18.05.2026	621	1,76	
145 US Bancorp, Series J, 5,300 %, Ewige Anleihe *	146	0,41	
170 Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	170	0,48	
	2.179	6,18	
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.679 \$)	2.709	7,68	
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 74,58 % (28. Februar 2025: 51,30 %)			
USA – 74,58 % (28. Februar 2025: 51,30 %)			
5.720 United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027 *	5.727	16,23	
5.710 United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027 *	5.720	16,21	
280 United States Treasury Floating Rate Note, 3,742 %, fällig 31.01.2028 *	280	0,79	
5.710 United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027 *	5.717	16,21	
1.050 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	1.055	2,99	
4.350 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	4.357	12,35	
470 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	482	1,37	
2.920 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	2.973	8,43	
	26.311	74,58	
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 26.075 \$)	26.311	74,58	
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,08 % (28. Februar 2025: 2,02 %)			
732 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	732	2,08	
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 732 \$)	732	2,08	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	35.164	99,68	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	35.164	99,68	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	114	0,32	
Gesamtnettovermögen	35.278 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 200.000 \$ und machten 0,57 % des Nettovermögens aus.

* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.

ABKÜRZUNGEN:

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,87 %		
1.994 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	1.994	2,87
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.994 \$)	1.994	2,87
Stammaktien – 93,07 %		
Australien – 0,58 %		
AUD 57 Qantas Airways Ltd	406	0,58
Brasilien – 1,55 %		
BRL 157 Multiplan Empreendimentos Imobiliarios SA	1.078	1,55
Kanada – 2,53 %		
CAD 1 Constellation Software Inc/Canada	1.281	1,85
CAD 8 Magna International Inc	476	0,68
	1.757	2,53
Chile – 0,65 %		
CLP 2.175 Banco de Chile	454	0,65
China – 5,76 %		
5 Alibaba Group Holding Ltd ADR	729	1,05
20 Baidu Inc ADR	2.444	3,52
16 Trip.com Group Ltd ADR	821	1,19
	3.994	5,76
Frankreich – 5,62 %		
EUR 23 BNP Paribas SA	2.577	3,71
EUR 34 Edenred SE	793	1,14
EUR 9 Teleperformance SE	533	0,77
	3.903	5,62
Deutschland – 1,23 %		
EUR 14 Deutsche Post AG	852	1,23
Indonesien – 2,88 %		
IDR 6.172 Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.437	2,07
IDR 2.640 Telkom Indonesia Persero Tbk PT	560	0,81
	1.997	2,88
Irland – 3,13 %		
15 AerCap Holdings NV	2.175	3,13
Japan – 5,45 %		
JPY 31 Kansai Paint Co Ltd	554	0,80
JPY 19 Open House Group Co Ltd	1.373	1,98
JPY 56 Shimamura Co Ltd	1.294	1,86
JPY 12 Visional Inc	559	0,81
	3.780	5,45
Niederlande – 2,47 %		
EUR 12 Heineken NV	1.084	1,56
EUR 19 Randstad NV	629	0,91
	1.713	2,47
Norwegen – 1,98 %		
NOK 27 DNB Bank ASA	844	1,22
NOK 22 Mowi ASA	528	0,76
	1.372	1,98
Panama – 1,60 %		
8 Copa Holdings SA	1.108	1,60
Spanien – 2,44 %		
EUR 80 Banco Santander SA	1.009	1,45
EUR 35 Puig Brands SA	685	0,99
	1.694	2,44
Schweden – 2,49 %		
SEK 6 Autoliv Inc	745	1,07
SEK 34 SKF AB	984	1,42
	1.729	2,49
Taiwan – 1,92 %		
4 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	1.334	1,92
Vereinigtes Königreich – 5,31 %		
GBP 238 B&M European Value Retail SA	613	0,88
GBP 203 Barratt Redrow Plc	1.000	1,44
GBP 11 Bellway Plc	418	0,60
GBP 45 Diageo Plc	998	1,44
GBP 15 Greggs Plc	316	0,46
GBP 4 Reckitt Benckiser Group Plc	341	0,49
	3.686	5,31
USA – 45,48 %		
14 Abercrombie & Fitch Co	1.349	1,94
4 Adobe Inc	950	1,37
6 Alphabet Inc 'A'	1.757	2,53
13 BioMarin Pharmaceutical Inc	802	1,16

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
6 Citigroup Inc	639	0,92
61 CNH Industrial NV	745	1,07
51 Comcast Corp	1.588	2,29
14 CVS Health Corp	1.134	1,63
19 Delta Air Lines Inc	1.264	1,82
8 Dollar General Corp	1.273	1,83
2 FedEx Corp	782	1,13
20 Global Payments Inc	1.533	2,21
40 GSK Plc	1.177	1,70
3 Humana Inc	503	0,72
10 ICON Plc	1.027	1,48
18 Kimberly-Clark Corp	1.963	2,83
17 Kroger Co/The	1.131	1,63
4 M&T Bank Corp	859	1,24
6 Medtronic Plc	616	0,89
1 Meta Platforms Inc 'A'	776	1,12
5 Middleby Corp/The	854	1,23
18 ON Semiconductor Corp	1.216	1,75
7 Salesforce Inc	1.367	1,97
10 Sanofi SA	991	1,43
6 Valero Energy Corp	1.322	1,91
26 Versant Media Group Inc	861	1,24
32 Viatis Inc	475	0,68
6 Walt Disney Co/The	649	0,94
4 Willis Towers Watson Plc	1.084	1,56
7 Zoetis Inc	875	1,26
	31.562	45,48
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 57.205 \$)	64.594	93,07
Vorzugsaktien – 2,07 %		
Brasilien – 1,33 %		
BRL 101 Itau Unibanco Holding SA	923	1,33
Deutschland – 0,74 %		
EUR 4 Volkswagen AG	511	0,74
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 1.084 \$)	1.434	2,07
Real Estate Investment Trusts – 2,06 %		
Mexiko – 0,66 %		
MXN 262 Fibra Uno Administracion SA de CV	456	0,66
USA – 1,40 %		
55 Healthpeak Properties Inc	972	1,40
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 1.310 \$)	1.428	2,06
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	69.450	100,07
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	69.450	100,07
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-48	-0,07
Gesamtvermögen	69.402 \$	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
CLP	– Chilenischer Peso
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund
DR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
MXN	– Mexikanischer Peso
NOK	– Norwegische Krone
SEK	– Schwedische Krone

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,98
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,87
Sonstige Vermögenswerte	0,15
Gesamtvermögen	100,00

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 97,17 % (28. Februar 2025: 91,47 %)			Medien – 2,11 % (28. Februar 2025: 0,81 %)		
Autoteile u. Ausstattung – 0,76 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			124 Walt Disney Co/The 13.160 2,11		
HKD	75 Contemporary Amperex Technology Co Ltd	4.706 0,76	Bergbau – 3,27 % (28. Februar 2025: 1,27 %)		
Banken – 7,45 % (28. Februar 2025: 5,40 %)			130 Freeport-McMoRan Inc 8.871 1,42		
415 Bank of America Corp 20.673 3,32			89 Newmont Corp 11.508 1,85		
211 Fifth Third Bancorp 10.436 1,67					
418 First Horizon Corp 9.950 1,60			Fertigung diverse – 1,54 % (28. Februar 2025: 1,63 %)		
74 Webster Financial Corp 5.368 0,86			EUR 33 Siemens AG 9.566 1,54		
			Öl u. Gas – 4,72 % (28. Februar 2025: 4,91 %)		
46.427 7,45			91 Chevron Corp 16.977 2,73		
Getränke – 2,01 % (28. Februar 2025: 1,13 %)			202 EQT Corp 12.405 1,99		
103 Celsius Holdings Inc 5.537 0,89					
231 Keurig Dr Pepper Inc 6.992 1,12			29.382 4,72		
			Öl- u. Gasdienstleistungen – 1,87 % (28. Februar 2025: 1,96 %)		
12.529 2,01			227 SLB Ltd 11.635 1,87		
Biotechnologie – 4,63 % (28. Februar 2025: 5,20 %)			Pharma – 9,73 % (28. Februar 2025: 9,08 %)		
7 Argenx SE ADR 5.704 0,91			48 Becton Dickinson & Co 8.453 1,36		
128 Corteva Inc 10.253 1,65			159 CVS Health Corp 12.674 2,03		
87 Gilead Sciences Inc 12.891 2,07			359 Elanco Animal Health Inc 9.478 1,52		
			85 Johnson & Johnson 21.004 3,37		
Baumaterialien – 2,08 % (28. Februar 2025: 2,18 %)			EUR 30 UCB SA 9.013 1,45		
90 Johnson Controls International plc 12.958 2,08			60.622 9,73		
Chemie – 2,11 % (28. Februar 2025: 1,11 %)			Pipelines – 2,43 % (28. Februar 2025: 2,49 %)		
92 Eastman Chemical Co 6.925 1,11			122 Kinetik Holdings Inc 'A' 5.549 0,89		
76 International Flavors & Fragrances Inc 6.225 1,00			426 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' # 9.602 1,54		
			15.151 2,43		
13.150 2,11			Einzelhandel – 2,16 % (28. Februar 2025: 2,93 %)		
Kohle – 1,31 % (28. Februar 2025: 1,26 %)			62 Genuine Parts Co 7.368 1,18		
139 Teck Resources Ltd 8.191 1,31			16 Murphy USA Inc 6.092 0,98		
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,44 % (28. Februar 2025: 5,96 %)			13.460 2,16		
126 Block Inc 8.017 1,29			Halbleiter – 4,72 % (28. Februar 2025: 2,70 %)		
94 Global Payments Inc 7.186 1,15			87 Microchip Technology Inc 6.493 1,04		
			37 Micron Technology Inc 15.335 2,46		
15.203 2,44			20 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR 7.568 1,22		
Computer – 0,41 % (28. Februar 2025: 1,06 %)			29.396 4,72		
51 Globant SA 2.541 0,41			Software – 1,34 % (28. Februar 2025: 2,97 %)		
Distribution u. Großhandel – 2,79 % (28. Februar 2025: 1,76 %)			43 Salesforce Inc 8.357 1,34		
JPY	238 Marubeni Corp	9.102 1,46	Transportwesen – 4,59 % (28. Februar 2025: 1,13 %)		
	29 WESCO International Inc	8.265 1,33	112 Canadian Pacific Kansas City Ltd 9.790 1,57		
		17.367 2,79	182 GXO Logistics Inc 11.440 1,84		
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,52 % (28. Februar 2025: 4,58 %)			61 TFI International Inc 7.344 1,18		
44 Capital One Financial Corp 8.511 1,37			28.574 4,59		
115 Charles Schwab Corp/The 10.971 1,76			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 490.198 \$) 605.263 97,17		
60 Intercontinental Exchange Inc 9.774 1,57			Real Estate Investment Trusts – 1,92 % (28. Februar 2025: 2,36 %)		
93 OneMain Holdings Inc 5.119 0,82			REITS – 1,92 % (28. Februar 2025: 2,36 %)		
34.375 5,52			136 American Homes 4 Rent 'A' 4.084 0,65		
Strom – 5,97 % (28. Februar 2025: 4,63 %)			41 American Tower Corp 7.901 1,27		
537 PG&E Corp 10.196 1,64			11.985 1,92		
257 PPL Corp 10.011 1,61			Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 13.591 \$) 11.985 1,92		
27 Talen Energy Corp 9.873 1,58			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 503.789 \$) 617.248 99,09		
41 Vistra Corp 7.092 1,14			Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,07 %)		
37.172 5,97			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten) 8 –		
Energie – 1,66 % (28. Februar 2025: 1,45 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte 617.256 99,09		
91 ConocoPhillips 10.336 1,66			Devisenterminkontrakte – -0,05 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Umweltkontrolle – 1,71 % (28. Februar 2025: 1,28 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten) -335 -0,05		
36 Clean Harbors Inc 10.633 1,71			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten -335 -0,05		
Ernährung – 2,62 % (28. Februar 2025: 3,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten 616.921 99,04		
89 Nestle SA ADR 9.748 1,56			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte 5.984 0,96		
68 Performance Food Group Co 6.590 1,06			Gesamtnettovermögen 622.905 \$ 100,00		
16.338 2,62			– 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 %.		
Gesundheit – Produkte – 1,35 % (28. Februar 2025: 1,15 %)			# Master Limited Partnership.		
86 Medtronic Plc 8.397 1,35					
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,45 % (28. Februar 2025: 3,22 %)					
31 UnitedHealth Group Inc 9.034 1,45					
Holdinggesellschaften – Diversifiziert: 0,58 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
343 Rice Acquisition Corp 3 3.585 0,58					
Versicherung – 4,95 % (28. Februar 2025: 8,35 %)					
382 Corebridge Financial Inc 9.878 1,59					
CAD	6 Fairfax Financial Holdings Ltd	10.140 1,63			
	229 MGIC Investment Corp	6.061 0,97			
	121 Ryan Specialty Holdings Inc 'A'	4.768 0,76			
		30.847 4,95			
Internet – 6,89 % (28. Februar 2025: 2,73 %)					
93 Alphabet Inc 'A' 29.042 4,66					
66 Amazon.com Inc 13.902 2,23					
42.944 6,89					

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Value Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,43
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	1,57
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 367	Verkauf	EUR 308	\$	3
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 15.555	Verkauf	EUR 13.189		-39
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 13	Verkauf	SGD 17		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 1	Verkauf	SGD 3		–
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 1.836	Verkauf	USD 1.454		-1
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 11	Verkauf	USD 9		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 27.889	Verkauf	USD 33.269		-295
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 953	Verkauf	USD 1.121		5
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 802 \$)						\$	8
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -2 \$)							-335
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 800 \$)						\$	-327

FTGF Putnam US Research Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 1,80 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
26.454 JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	26.454	1,80
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 26.454 \$)	26.454	1,80
Stammaktien – 94,10 % (28. Februar 2025: 97,69 %)		
Fluggesellschaften – 0,33 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
100 Southwest Airlines Co	4.924	0,33
Bekleidung – 0,37 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
139 Levi Strauss & Co	3.085	0,21
7 NIKE Inc	442	0,03
42 On Holding AG	1.945	0,13
	5.472	0,37
Automobilhersteller – 1,23 % (28. Februar 2025: 0,46 %)		
51 General Motors Co	4.050	0,28
35 Tesla Inc	14.030	0,95
	18.080	1,23
Banken – 2,35 % (28. Februar 2025: 6,64 %)		
154 Bank of America Corp	7.674	0,52
140 Citigroup Inc	15.438	1,05
31 JPMorgan Chase & Co	9.256	0,63
10 PNC Financial Services Group Inc/The	2.208	0,15
	34.576	2,35
Getränke – 1,89 % (28. Februar 2025: 2,38 %)		
260 Coca-Cola Co/The	21.199	1,44
100 Keurig Dr Pepper Inc	3.025	0,20
21 PepsiCo Inc	3.635	0,25
	27.859	1,89
Biotechnologie – 2,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
1 Amgen Inc	322	0,02
20 Bio-Rad Laboratories Inc	5.696	0,39
74 Corvea Inc	5.922	0,40
37 Gilead Sciences Inc	5.467	0,37
10 Regeneron Pharmaceuticals Inc	7.849	0,54
8 Vertex Pharmaceuticals Inc	4.153	0,28
	29.409	2,00
Baumaterialien – 1,10 % (28. Februar 2025: 1,25 %)		
77 CRH Plc	9.293	0,63
15 Trane Technologies Plc	6.959	0,47
	16.252	1,10
Chemie – 1,19 % (28. Februar 2025: 2,97 %)		
6 Linde Plc	2.807	0,19
38 PPG Industries Inc	4.736	0,32
40 Qnity Electronics Inc	5.059	0,35
62 Solstice Advanced Materials Inc	4.862	0,33
	17.464	1,19
Gewerbliche Dienstleistungen – 0,59 % (28. Februar 2025: 2,05 %)		
13 Cintas Corp	2.563	0,17
7 United Rentals Inc	6.166	0,42
	8.729	0,59
Computer – 5,09 % (28. Februar 2025: 6,05 %)		
256 Apple Inc	67.626	4,59
115 Pure Storage Inc	7.353	0,50
	74.979	5,09
Kosmetik u. Körperpflege – 1,05 % (28. Februar 2025: 1,30 %)		
93 Procter & Gamble Co/The	15.510	1,05
Distribution u. Großhandel – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
62 Copart Inc	2.358	0,16
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 5,64 % (28. Februar 2025: 5,22 %)		
58 Apollo Global Management Inc	6.058	0,41
6 Blackrock Inc	6.833	0,46
75 Capital One Financial Corp	14.733	1,00
97 Charles Schwab Corp/The	9.263	0,63
15 CME Group Inc	4.823	0,33
39 Mastercard Inc	20.280	1,38
56 Nasdaq Inc	4.891	0,33
99 TPG Inc 'A'	4.318	0,29
37 Visa Inc 'A'	11.937	0,81
	83.136	5,64
Strom – 2,16 % (28. Februar 2025: 1,64 %)		
86 CenterPoint Energy Inc	3.742	0,25
8 Constellation Energy Corp	2.533	0,17
84 NextEra Energy Inc	7.888	0,54

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
51 NRG Energy Inc	9.201	0,63
106 PPL Corp	4.147	0,28
51 Xcel Energy Inc	4.226	0,29
	31.737	2,16
Elektronik – 2,02 % (28. Februar 2025: 1,91 %)		
120 Fortive Corp	7.078	0,48
93 Honeywell International Inc	22.651	1,54
	29.729	2,02
Unterhaltung – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
53 Live Nation Entertainment Inc	8.552	0,58
Umweltkontrolle – 0,23 % (28. Februar 2025: 1,82 %)		
20 Waste Connections Inc	3.383	0,23
Ernährung – 0,30 % (28. Februar 2025: 0,28 %)		
47 Mondelez International Inc	2.905	0,20
16 US Foods Holding Corp	1.511	0,10
	4.416	0,30
Gesundheit – Produkte – 2,41 % (28. Februar 2025: 2,63 %)		
18 Abbott Laboratories	2.124	0,15
83 Boston Scientific Corp	6.382	0,43
9 Danaher Corp	1.965	0,13
35 Edwards Lifesciences Corp	3.027	0,21
11 Intuitive Surgical Inc	5.588	0,38
17 Medtronic Plc	1.624	0,11
5 Stryker Corp	2.066	0,14
24 Thermo Fisher Scientific Inc	12.711	0,86
	35.487	2,41
Gesundheit – Dienstleistungen – 0,76 % (28. Februar 2025: 1,17 %)		
5 HCA Healthcare Inc	2.795	0,19
29 UnitedHealth Group Inc	8.395	0,57
	11.190	0,76
Versicherung – 3,94 % (28. Februar 2025: 6,65 %)		
56 Allstate Corp/The	12.098	0,82
87 American International Group Inc	7.016	0,48
14 Aon Plc	4.699	0,32
50 Arch Capital Group Ltd	4.993	0,34
14 Assured Guaranty Ltd	1.245	0,08
28 AXA SA	1.378	0,09
33 Berkshire Hathaway Inc 'B'	16.885	1,15
64 Corebridge Financial Inc	1.652	0,11
327 Prudential Plc	5.009	0,34
42 Unum Group	3.013	0,21
	57.988	3,94
Internet – 12,98 % (28. Februar 2025: 12,32 %)		
246 Alphabet Inc 'A'	76.585	5,20
286 Amazon.com Inc	60.158	4,08
58 Meta Platforms Inc 'A'	37.811	2,57
108 Netflix Inc	10.429	0,71
12 Spotify Technology SA	6.257	0,42
	191.240	12,98
Maschinen – Bau u. Bergbau – 0,74 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
12 GE Vernova Inc	10.841	0,74
Maschinen – Diversifiziert – 1,40 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
115 Ingersoll Rand Inc	10.792	0,73
106 Otis Worldwide Corp	9.839	0,67
	20.631	1,40
Medien – 1,26 % (28. Februar 2025: 1,71 %)		
50 Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	4.586	0,31
131 Walt Disney Co/The	13.931	0,95
	18.517	1,26
Bergbau – 0,31 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
GBP 636 Glencore Plc	4.595	0,31
Öl u. Gas – 3,84 % (28. Februar 2025: 0,67 %)		
62 Antero Resources Corp	2.278	0,15
GBP 422 BP Plc	2.735	0,19
CAD 362 Cenovus Energy Inc	8.062	0,55
104 ConocoPhillips	11.804	0,80
180 Exxon Mobil Corp	27.423	1,86
GBP 101 Shell Plc	4.225	0,29
	56.527	3,84
Öl- u. Gasdienstleistungen – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
23 SLB Ltd	1.177	0,08

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam US Research Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Stammaktien – (Fortsetzung)		
Pharma – 5,89 % (28. Februar 2025: 6,22 %)		
50 AbbVie Inc	11.643	0,79
24 Becton Dickinson & Co	4.276	0,29
61 Bristol-Myers Squibb Co	3.780	0,26
10 Cardinal Health Inc	2.296	0,16
2 Cencora Inc	736	0,05
38 CVS Health Corp	3.000	0,20
40 Dexcom Inc	2.912	0,20
24 Eli Lilly & Co	24.960	1,69
58 Johnson & Johnson	14.362	0,98
11 McKesson Corp	10.511	0,71
66 Merck & Co Inc	8.203	0,56
	86.679	5,89
Private Equity – 0,17 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
29 KKR & Co Inc	2.523	0,17
Immobilien – 0,16 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
16 CBRE Group Inc 'A'	2.328	0,16
Einzelhandel – 4,26 % (28. Februar 2025: 6,25 %)		
36 BJ's Wholesale Club Holdings Inc	3.556	0,24
65 Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	2.425	0,16
7 Costco Wholesale Corp	7.021	0,48
28 Home Depot Inc/The	10.704	0,73
17 McDonald's Corp	5.694	0,38
26 Starbucks Corp	2.529	0,17
21 Target Corp	2.404	0,16
47 TJX Cos Inc/The	7.628	0,52
2 Ulta Beauty Inc	1.573	0,11
150 Walmart Inc	19.251	1,31
	62.785	4,26
Halbleiter – 16,54 % (28. Februar 2025: 7,81 %)		
87 Advanced Micro Devices Inc	17.440	1,18
93 Analog Devices Inc	33.229	2,25
138 Broadcom Inc	44.158	3,00
136 Lam Research Corp	31.793	2,16
267 Marvell Technology Inc	21.790	1,48
538 NVIDIA Corp	95.262	6,47
	243.672	16,54
Software – 7,74 % (28. Februar 2025: 10,49 %)		
204 Microsoft Corp	80.025	5,43
124 Oracle Corp	18.061	1,23
82 Palantir Technologies Inc	11.298	0,77
28 Snowflake Inc	4.630	0,31
	114.014	7,74
Telekommunikation – 1,99 % (28. Februar 2025: 1,51 %)		
368 Cisco Systems Inc	29.242	1,99
Transportwesen – 1,35 % (28. Februar 2025: 1,09 %)		
30 FedEx Corp	11.427	0,77
32 Union Pacific Corp	8.512	0,58
	19.939	1,35
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.322.757 \$)	1.385.940	94,10
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Staatspapiere – 0,20 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
900 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 23.04.2026 =	895	0,06
2.090 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.07.2026 =	2.062	0,14
	2.957	0,20
Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.957 \$)	2.957	0,20

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 80	Verkauf CHF 62	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1	Verkauf CHF 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 881	Verkauf EUR 743	4
13. März 2026	BNY	Kauf USD 648	Verkauf EUR 550	–
13. März 2026	BNY	Kauf USD 1	Verkauf GBP 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf AUD 173	Verkauf USD 122	1
13. März 2026	BNY	Kauf CHF 157	Verkauf USD 204	1
13. März 2026	BNY	Kauf CHF 1.051	Verkauf USD 1.376	-7
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 2.792	Verkauf USD 3.291	9

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Real Estate Investment Trusts – 2,16 % (28. Februar 2025: 1,07 %)		
REITS – 2,16 % (28. Februar 2025: 1,07 %)		
80 American Tower Corp	15.409	1,05
59 Prologis Inc	8.401	0,57
39 Welltower Inc	8.010	0,54
	31.820	2,16
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 29.692 \$)	31.820	2,16
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 1.381.860 \$)		
	1.447.171	98,26
Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	54	–
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.447.225	98,26
Devisenterminkontrakte – -0,12 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-1.759	-0,12
Futures – -0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-289	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-2.048	-0,14
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.445.177	98,12
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	27.693	1,88
Gesamtnettvermögen	1.472.870 \$	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 (in seiner Gesamtheit oder in Teilen) ist zum 28. Februar 2026 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

ABKÜRZUNGEN:

CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamt- vermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,07
Organismen für gemeinsame Anlagen	1,79
Finanzderivate	–
Sonstige Vermögenswerte	2,14
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam US Research Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte – (Fortsetzung)

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 130.120	Verkauf	USD 155.197	\$ -1.341	
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 6.916	Verkauf	USD 9.449	-127	
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 12	Verkauf	USD 6	–	
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 505	Verkauf	CHF 397	-12	
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 53	Verkauf	EUR 45	–	
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 3.168	Verkauf	GBP 2.358	-11	
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	GBP 3.032	Verkauf	USD 4.091	-6	
17. März 2026	Barclays	Kauf	USD 11	Verkauf	EUR 10	–	
17. März 2026	Barclays	Kauf	USD 482	Verkauf	GBP 359	-2	
17. März 2026	Citi	Kauf	USD 26	Verkauf	EUR 22	–	
17. März 2026	Citi	Kauf	USD 26	Verkauf	EUR 22	–	
17. März 2026	Citi	Kauf	USD 289	Verkauf	GBP 215	-1	
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 670	Verkauf	EUR 567	-1	
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 1.531	Verkauf	GBP 1.140	-5	
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 443	Verkauf	GBP 328	1	
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD 508	Verkauf	GBP 372	7	
17. März 2026	HSBC	Kauf	GBP 864	Verkauf	USD 1.178	-14	
17. März 2026	JP Morgan	Kauf	USD 571	Verkauf	DKK 3.605	–	
17. März 2026	JP Morgan	Kauf	USD 4.602	Verkauf	SEK 41.380	13	
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 135	Verkauf	EUR 115	-1	
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 267	Verkauf	GBP 198	–	
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 5.269	Verkauf	GBP 3.946	-49	
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 66	Verkauf	EUR 56	–	
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 30	Verkauf	EUR 25	–	
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 3.837	Verkauf	GBP 2.874	-36	
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 694	Verkauf	SEK 6.410	-17	
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	GBP 351	Verkauf	USD 477	-4	
17. März 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD 58	Verkauf	EUR 49	–	
17. März 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD 2.985	Verkauf	GBP 2.222	-9	
17. März 2026	UBS	Kauf	USD 35	Verkauf	EUR 30	–	
17. März 2026	UBS	Kauf	USD 831	Verkauf	GBP 622	-8	
17. März 2026	UBS	Kauf	USD 450	Verkauf	GBP 327	9	
17. März 2026	Westpac Banking Corporation	Kauf	USD 803	Verkauf	GBP 596	–	
15. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD 260	Verkauf	CAD 359	-4	
15. Apr. 2026	Barclays	Kauf	USD 667	Verkauf	CAD 923	-11	
15. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD 272	Verkauf	CAD 376	-4	
15. Apr. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 1.599	Verkauf	CAD 2.212	-26	
15. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD 176	Verkauf	CAD 238	1	
15. Apr. 2026	HSBC	Kauf	CAD 544	Verkauf	USD 394	6	
15. Apr. 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 1.473	Verkauf	CAD 2.026	-15	
15. Apr. 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD 150	Verkauf	CAD 202	2	
15. Apr. 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD 2.029	Verkauf	CAD 2.804	-31	
15. Apr. 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD 999	Verkauf	CAD 1.381	-15	
15. Apr. 2026	UBS	Kauf	USD 73	Verkauf	CAD 101	-1	
13. Mai. 2026	Barclays	Kauf	HKD 3.734	Verkauf	USD 479	-1	
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD 375	Verkauf	HKD 2.924	–	
13. Mai. 2026	HSBC	Kauf	USD 18	Verkauf	HKD 136	–	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)						\$ 54	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)						-1.759	
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)						\$ -1.705	

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
S&P 500 Index März 2026	Bank of America Merrill Lynch	95	\$ 32.723	\$ -289
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				-289
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)				\$ -289

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 99,20 % (28. Februar 2025: 96,02 %)		
Automobilhersteller – 1,85 % (28. Februar 2025: 1,53 %)		
64 Tesla Inc	25.827	1,85
Getränke – 1,24 % (28. Februar 2025: 1,28 %)		
203 Monster Beverage Corp	17.330	1,24
Biotechnologie – 2,26 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
64 Vertex Pharmaceuticals Inc	31.561	2,26
Chemie – 3,81 % (28. Februar 2025: 1,66 %)		
49 Linde Plc	24.837	1,77
79 Sherwin-Williams Co/The	28.512	2,04
	53.349	3,81
Gewerbliche Dienstleistungen – 0,98 % (28. Februar 2025: 3,38 %)		
31 S&P Global Inc	13.786	0,98
Computer – 5,82 % (28. Februar 2025: 6,76 %)		
308 Apple Inc	81.479	5,82
Distribution u. Großhandel – 2,54 % (28. Februar 2025: 1,86 %)		
31 WW Grainger Inc	35.614	2,54
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,17 % (28. Februar 2025: 4,98 %)		
183 Visa Inc 'A'	58.406	4,17
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 2,83 % (28. Februar 2025: 1,74 %)		
105 Eaton Corp Plc	39.631	2,83
Elektronik – 1,78 % (28. Februar 2025: 1,50 %)		
102 Honeywell International Inc	24.963	1,78
Gesundheit – Produkte – 6,46 % (28. Februar 2025: 6,02 %)		
79 Intuitive Surgical Inc	39.521	2,83
67 Stryker Corp	26.071	1,86
48 Thermo Fisher Scientific Inc	24.762	1,77
	90.354	6,46
Versicherung – 1,71 % (28. Februar 2025: 1,50 %)		
128 Marsh & McLennan Cos Inc	23.927	1,71
Internet – 27,93 % (28. Februar 2025: 26,73 %)		
177 Airbnb Inc	23.914	1,71
163 Alphabet Inc 'A'	50.795	3,63
449 Amazon.com Inc	94.335	6,74
162 Meta Platforms Inc 'A'	105.126	7,51
648 Netflix Inc	62.429	4,46
211 Palo Alto Networks Inc	31.360	2,24
304 Uber Technologies Inc	22.926	1,64
	390.885	27,93
Fertigung diverse – 0,88 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
12 Parker-Hannifin Corp	12.280	0,88
Pharma – 1,11 % (28. Februar 2025: 3,45 %)		
262 Roche Holding AG ADR	15.588	1,11
Einzelhandel – 1,74 % (28. Februar 2025: 1,83 %)		
653 Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	24.317	1,74

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	BNY	Kauf	USD 54.587	\$ -335
03. März 2026	BNY	Kauf	BRL 281.559	939
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 988	-2
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 2.039	7
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 128	–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 17.761	-188
02. Apr. 2026	BNY	Kauf	BRL 257.728	216
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 1.978 \$)				\$ 1.162
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.354 \$)				-525
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 624 \$)				\$ 637

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Halbleiter – 16,94 % (28. Februar 2025: 11,97 %)		
25 ASML Holding NV	35.992	2,57
107 Broadcom Inc	34.161	2,44
712 NVIDIA Corp	126.077	9,01
94 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	35.338	2,52
26 Texas Instruments Inc	5.530	0,40
	237.098	16,94
Software – 13,61 % (28. Februar 2025: 15,64 %)		
77 Datadog Inc	8.651	0,62
9 Fair Isaac Corp	12.263	0,88
43 Intuit Inc	17.403	1,24
196 Microsoft Corp	76.995	5,50
208 Oracle Corp	30.198	2,16
49 Salesforce Inc	9.531	0,68
107 ServiceNow Inc	11.518	0,82
58 Synopsys Inc	23.883	1,71
	190.442	13,61
Telekommunikation – 1,54 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
161 Arista Networks Inc	21.531	1,54
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 894.961 \$)		
	1.388.368	99,20
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 894.961 \$)		
	1.388.368	99,20
Devisenterminkontrakte – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,10 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	1.162	0,09
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	1.389.530	99,29
Devisenterminkontrakte – -0,04 % (28. Februar 2025: -0,07 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-525	-0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-525	-0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	1.389.005	99,25
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	10.549	0,75
Gesamtnettvermögen		
	1.399.554 \$	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

	% des Gesamtvermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,83
Finanzderivate	0,08
Sonstige Vermögenswerte	1,09
Gesamtvermögen	100,00

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 84,86 % (28. Februar 2025: 77,38 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 4,75 % (28. Februar 2025: 1,56 %)		
3 L3Harris Technologies Inc	947	2,43
1 Northrop Grumman Corp	902	2,32
	1.849	4,75
Banken – 5,87 % (28. Februar 2025: 5,25 %)		
12 Bank of America Corp	580	1,49
6 Citigroup Inc	647	1,66
– Goldman Sachs Group Inc/The	292	0,75
3 JPMorgan Chase & Co	765	1,97
	2.284	5,87
Getränke – 1,18 % (28. Februar 2025: 1,07 %)		
6 Coca-Cola Co/The	459	1,18
Biotechnologie – 1,00 % (28. Februar 2025: 0,76 %)		
1 Amgen Inc	390	1,00
Computer – 2,60 % (28. Februar 2025: 2,48 %)		
4 Apple Inc	1.010	2,60
Kosmetik u. Körperpflege – 3,30 % (28. Februar 2025: 2,80 %)		
6 Colgate-Palmolive Co	640	1,65
4 Procter & Gamble Co/The	644	1,65
	1.284	3,30
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 2,46 % (28. Februar 2025: 4,15 %)		
5 Ares Management Corp 'A'	538	1,39
2 Charles Schwab Corp/The	199	0,51
1 Intercontinental Exchange Inc	218	0,56
	955	2,46
Strom – 5,25 % (28. Februar 2025: 2,14 %)		
6 DTE Energy Co	923	2,37
12 NextEra Energy Inc	1.117	2,88
	2.040	5,25
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 3,21 % (28. Februar 2025: 1,45 %)		
1 Eaton Corp Plc	555	1,43
2 Emerson Electric Co	693	1,78
	1.248	3,21
Elektronik – 1,38 % (28. Februar 2025: 1,41 %)		
4 Amphenol Corp 'A'	535	1,38
Ernährung – 1,53 % (28. Februar 2025: 1,47 %)		
8 McCormick & Co Inc/MD	595	1,53
Gas – 1,38 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
3 Atmos Energy Corp	537	1,38
Gesundheit – Produkte: 1,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
3 Abbott Laboratories	392	1,01
Bauunternehmen – 1,56 % (28. Februar 2025: 1,12 %)		
5 Lennar Corp	605	1,56
Versicherung – 0,95 % (28. Februar 2025: 1,30 %)		
5 MetLife Inc	370	0,95
Internet – 3,85 % (28. Februar 2025: 2,31 %)		
3 Alphabet Inc 'A'	901	2,31
1 Meta Platforms Inc 'A'	598	1,54
	1.499	3,85
Bergbau – 2,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
11 Freeport-McMoRan Inc	779	2,00
Pharma – 9,07 % (28. Februar 2025: 8,66 %)		
2 AbbVie Inc	369	0,95
– Eli Lilly & Co	266	0,68
– Johnson & Johnson	497	1,28
1 McKesson Corp	786	2,02
7 Merck & Co Inc	823	2,12
13 Roche Holding AG ADR	785	2,02
	3.526	9,07
Pipelines – 15,97 % (28. Februar 2025: 15,72 %)		
1 Cheniere Energy Inc	204	0,52
11 Enbridge Inc	591	1,52
32 Kinder Morgan Inc	1.060	2,73
10 ONEOK Inc	821	2,11
38 Plains GP Holdings LP, MLP 'A' #	855	2,20
4 Sunoco Corp LLC	210	0,54
2 Targa Resources Corp	354	0,91
8 TC Energy Corp	501	1,29
22 Williams Cos Inc/The	1.612	4,15
	6.208	15,97

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Private Equity – 0,65 % (28. Februar 2025: 2,30 %)		
2 Blackstone Inc	252	0,65
Einzelhandel – 1,79 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
5 Walmart Inc	696	1,79
Halbleiter – 6,77 % (28. Februar 2025: 7,49 %)		
– ASML Holding NV	608	1,57
2 Broadcom Inc	692	1,78
9 Marvell Technology Inc	764	1,96
4 QUALCOMM Inc	568	1,46
	2.632	6,77
Software – 3,16 % (28. Februar 2025: 7,03 %)		
2 Microsoft Corp	831	2,13
3 Oracle Corp	399	1,03
	1.230	3,16
Telekommunikation – 1,58 % (28. Februar 2025: 1,83 %)		
3 T-Mobile US Inc	615	1,58
Transportwesen – 2,59 % (28. Februar 2025: 1,68 %)		
4 Union Pacific Corp	1.006	2,59
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 24.400 \$)	32.996	84,86
Vorzugsaktien – 4,29 % (28. Februar 2025: 8,53 %)		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 1,96 % (28. Februar 2025: 1,56 %)		
10 Boeing Co/The	762	1,96
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 1,15 % (28. Februar 2025: 3,94 %)		
8 Apollo Global Management Inc	447	1,15
Private Equity – 0,66 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
6 KKR & Co Inc, Series D	256	0,66
Einzelhandel – 0,52 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
3 QXO Inc	202	0,52
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 1.517 \$)	1.667	4,29
Real Estate Investment Trusts – 7,67 % (28. Februar 2025: 10,18 %)		
REITS – 7,67 % (28. Februar 2025: 10,18 %)		
2 American Tower Corp	451	1,16
2 Digital Realty Trust Inc	423	1,09
– Equinix Inc	140	0,36
10 Equity LifeStyle Properties Inc	662	1,70
5 Prologis Inc	674	1,73
21 VICI Properties Inc 'A'	633	1,63
	2.983	7,67
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 2.892 \$)	2.983	7,67
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 28.809 \$)		
	37.646	96,82
Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,01 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	3	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	37.649	96,83
Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2025: -0,02 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-7	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-7	-0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	37.642	96,81
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	1.242	3,19
Gesamtvermögen	38.884 \$	100,00

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

Master Limited Partnership.

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

	% des Gesamt- vermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,44
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	3,55
Gesamtvermögen	100,00

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	11	Verkauf	AUD	16	\$	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	SGD	–		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	630	Verkauf	USD	751		-7
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH	387	Verkauf	USD	56		1
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	853	Verkauf	USD	605		2
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	560	Verkauf	USD	444		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 4 \$)								\$	3
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -10 \$)									-7
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -6 \$)								\$	-4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 94,95 % (28. Februar 2025: 95,61 %)			Einzelhandel – 5,69 % (28. Februar 2025: 5,09 %)		
Banken – 5,92 % (28. Februar 2025: 7,30 %)			5 Costco Wholesale Corp	4.551	0,72
214 Bank of America Corp	10.633	1,69	30 Ferguson Enterprises Inc	7.742	1,23
59 JPMorgan Chase & Co	17.626	2,81	29 Home Depot Inc/The	11.157	1,78
54 Morgan Stanley	8.930	1,42	76 TJX Cos Inc/The	12.304	1,96
	37.189	5,92		35.754	5,69
Biotechnologie – 1,78 % (28. Februar 2025: 2,51 %)			Halbleiter – 14,91 % (28. Februar 2025: 9,42 %)		
6 Argenx SE ADR	4.240	0,68	38 Analog Devices Inc	13.498	2,15
47 Gilead Sciences Inc	6.935	1,10	8 ASM International NV	6.351	1,01
	11.175	1,78	8 ASML Holding NV	11.394	1,81
Baumaterialien – 2,74 % (28. Februar 2025: 3,80 %)			50 Broadcom Inc	16.004	2,55
17 Trane Technologies Plc	7.946	1,26	262 NVIDIA Corp	46.444	7,39
30 Vulcan Materials Co	9.279	1,48		93.691	14,91
	17.225	2,74	Software – 6,06 % (28. Februar 2025: 11,23 %)		
Chemie – 3,86 % (28. Februar 2025: 1,35 %)			79 Microsoft Corp	31.207	4,97
29 Ecolab Inc	8.914	1,42	16 Oracle Corp	2.339	0,37
30 Linde Plc	15.331	2,44	11 Synopsys Inc	4.516	0,72
	24.245	3,86		38.062	6,06
Gewerbliche Dienstleistungen – 2,61 % (28. Februar 2025: 1,11 %)			Wasser – 0,86 % (28. Februar 2025: 1,67 %)		
71 UL Solutions Inc 'A'	5.930	0,94	40 American Water Works Co Inc	5.381	0,86
13 United Rentals Inc	10.495	1,67		596.651	94,95
	16.425	2,61	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 468.455 \$)		
Computer – 5,40 % (28. Februar 2025: 8,25 %)			Real Estate Investment Trusts – 2,97 % (28. Februar 2025: 3,39 %)		
128 Apple Inc	33.946	5,40	REITS – 2,97 % (28. Februar 2025: 3,39 %)		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,88 % (28. Februar 2025: 3,38 %)			11 Equinix Inc	10.615	1,69
71 Procter & Gamble Co/The	11.793	1,88	57 Prologis Inc	8.065	1,28
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,57 % (28. Februar 2025: 4,18 %)				18.680	2,97
10 Blackrock Inc	10.624	1,69	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 14.461 \$)		
37 Visa Inc 'A'	11.797	1,88		18.680	2,97
	22.421	3,57	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 482.916 \$)		
Strom – 2,88 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				615.331	97,92
228 Brookfield Renewable Partners LP	7.236	1,15	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,10 %)		
250 CenterPoint Energy Inc	10.876	1,73	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	18.112	2,88		9	–
Elektrische Komponenten u. Zubehör – 1,02 % (28. Februar 2025: 1,38 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
17 Eaton Corp Plc	6.397	1,02		615.340	97,92
Energie – Alternative Quellen – 0,43 % (28. Februar 2025: 0,37 %)			Devisenterminkontrakte – -0,41 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
64 Enphase Energy Inc	2.697	0,43	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
Umweltkontrolle – 3,39 % (28. Februar 2025: 1,96 %)				-2.612	-0,41
32 Clean Harbors Inc	9.348	1,49	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
52 Republic Services Inc 'A'	11.953	1,90		-2.612	-0,41
	21.301	3,39	Summe der erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Nahrungsmittel – 1,69 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				612.728	97,51
110 US Foods Holding Corp	10.604	1,69	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Gesundheit – Produkte – 2,58 % (28. Februar 2025: 2,59 %)				15.688	2,49
62 Cooper Cos Inc/The	5.224	0,83	Gesamtvermögen		
52 Danaher Corp	11.026	1,75		628.416 \$	100,00
	16.250	2,58	ABKÜRZUNGEN:		
Versicherung – 2,19 % (28. Februar 2025: 4,45 %)			ADR – American Depositary Receipt		
70 MetLife Inc	5.080	0,81	Verteilung des Gesamtvermögens		
28 Travelers Cos Inc/The	8.665	1,38	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
	13.745	2,19		97,13	
Internet – 13,31 % (28. Februar 2025: 11,01 %)			Finanzderivate		
98 Alphabet Inc 'A'	30.681	4,88		–	
121 Amazon.com Inc	25.337	4,03	Sonstige Vermögenswerte		
7 Applavin Corp 'A'	3.000	0,48		2,87	
186 Chewy Inc 'A'	5.087	0,81	Gesamtvermögen		
125 Netflix Inc	12.046	1,92		100,00	
50 Palo Alto Networks Inc	7.511	1,19	Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.		
	83.662	13,31			
Maschinen – Diversifiziert – 3,32 % (28. Februar 2025: 1,03 %)					
9 Deere & Co	5.365	0,86			
75 Flowserve Corp	6.666	1,06			
40 Regal Rexnord Corp	8.810	1,40			
	20.841	3,32			
Medien – 1,25 % (28. Februar 2025: 1,92 %)					
74 Walt Disney Co/The	7.872	1,25			
Metallherstellung u. -elemente – 1,23 % (28. Februar 2025: 0,00 %)					
17 Valmont Industries Inc	7.765	1,23			
Pharma – 6,38 % (28. Februar 2025: 6,52 %)					
52 CVS Health Corp	4.173	0,66			
98 Johnson & Johnson	24.394	3,88			
12 McKesson Corp	11.531	1,84			
	40.098	6,38			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	769	Verkauf	EUR	652	\$ -2
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	185	Verkauf	EUR	156	1
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	1.039	Verkauf	GBP	765	8
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	50	Verkauf	GBP	37	–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	21	Verkauf	USD	24	–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	173.129	Verkauf	USD	206.540	-1.833
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	38.317	Verkauf	USD	52.417	-777
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 926 \$)								\$ 9
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -3 \$)								-2.612
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 923 \$)								\$ -2.603

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 99,15 % (28. Februar 2025: 98,59 %)			USA – 57,99 % (28. Februar 2025: 60,65 %)		
Australien – 0,24 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			CHF	15 Alcon AG	1.329 0,68
AUD	5 Pro Medicus Ltd	460 0,24	30 Alphabet Inc 'A'	9.362 4,82	
Belgien – 2,29 % (28. Februar 2025: 0,67 %)			22 Amazon.com Inc	4.612 2,37	
EUR	15 KBC Group NV	2.027 1,04	17 Amphenol Corp 'A'	2.412 1,24	
EUR	8 UCB SA	2.431 1,25	28 Apple Inc	7.493 3,86	
		4.458 2,29	4 AppLovin Corp 'A'	1.690 0,87	
Brasilien – 1,87 % (28. Februar 2025: 0,87 %)			54 Bank of America Corp	2.690 1,38	
	1 MercadoLibre Inc	2.272 1,17	13 Broadcom Inc	4.162 2,14	
	91 NU Holdings Ltd/Cayman Islands	1.367 0,70	16 CG oncology Inc	955 0,49	
		3.639 1,87	38 Coca-Cola Co/The	3.087 1,59	
Kanada – 1,81 % (28. Februar 2025: 3,90 %)			3 Costco Wholesale Corp	3.315 1,71	
CAD	24 Dollarama Inc	3.520 1,81	4 Eaton Corp Plc	1.417 0,73	
China – 3,54 % (28. Februar 2025: 3,25 %)			4 Eli Lilly & Co	4.265 2,20	
HKD	103 BYD Co Ltd	1.237 0,64	4 Ferguson Enterprises Inc	1.119 0,58	
HKD	7 Laopu Gold Co Ltd	666 0,34	27 Fifth Third Bancorp	1.330 0,68	
HKD	59 Tencent Holdings Ltd	3.865 1,99	5 Honeywell International Inc	1.297 0,67	
HKD	73 WuXi AppTec Co Ltd, 144A	1.102 0,57	14 Ingersoll Rand Inc	1.360 0,70	
		6.870 3,54	11 Intercontinental Exchange Inc	1.828 0,94	
Frankreich – 0,57 % (28. Februar 2025: 3,46 %)			4 Intuitive Surgical Inc	2.026 1,04	
EUR	4 EssilorLuxottica SA	1.116 0,57	18 Johnson & Johnson	4.359 2,24	
Deutschland – 5,02 % (28. Februar 2025: 1,46 %)			32 Johnson Controls International plc	4.556 2,35	
EUR	135 E.ON SE	3.135 1,61	18 Life360 Inc	966 0,50	
EUR	5 Heidelberg Materials AG	1.169 0,60	5 Meta Platforms Inc 'A'	3.249 1,67	
EUR	5 MTU Aero Engines AG	1.959 1,01	12 Microsoft Corp	4.813 2,48	
EUR	18 Siemens Energy AG	3.495 1,80	13 Mirum Pharmaceuticals Inc	1.238 0,64	
		9.758 5,02	17 Netflix Inc	1.683 0,87	
Indien – 1,75 % (28. Februar 2025: 1,46 %)			17 NIKE Inc	1.070 0,55	
	107 HDFC Bank Ltd ADR	3.398 1,75	65 NVIDIA Corp	11.458 5,90	
Indonesien – 0,32 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			9 Republic Services Inc 'A'	2.076 1,07	
IDR	4.454 Unilever Indonesia Tbk PT	631 0,32	4 Roche Holding AG	1.786 0,92	
Italien – 2,64 % (28. Februar 2025: 2,62 %)			39 Roivant Sciences Ltd	1.114 0,57	
EUR	274 Intesa Sanpaolo SpA	1.889 0,97	4 Synopsys Inc	1.578 0,81	
EUR	27 Prysmian SpA	3.232 1,67	7 Tarsus Pharmaceuticals Inc	514 0,26	
		5.121 2,64	4 Thermo Fisher Scientific Inc	2.116 1,09	
Japan – 5,13 % (28. Februar 2025: 3,88 %)			2 Ulta Beauty Inc	1.666 0,86	
JPY	10 Hoya Corp	1.888 0,97	4 Vertex Pharmaceuticals Inc	2.071 1,07	
JPY	9 Lasertec Corp	2.026 1,05	21 Vertiv Holdings Co 'A'	5.241 2,70	
JPY	155 Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	2.876 1,48	27 Walmart Inc	3.476 1,79	
JPY	297 Pan Pacific International Holdings Corp	1.986 1,02	18 Walt Disney Co/The	1.875 0,96	
JPY	46 SoftBank Group Corp	1.188 0,61			
		9.964 5,13			
Niederlande – 1,22 % (28. Februar 2025: 1,58 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 186.517 \$)	112.654 57,99	
EUR	3 ASM International NV	2.361 1,22		192.610 99,15	
Singapur – 1,19 % (28. Februar 2025: 1,76 %)			Optionsscheine – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
	21 Sea Ltd ADR	2.302 1,19	Kanada – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Südkorea – 1,85 % (28. Februar 2025: 0,90 %)			CAD	– Constellation Software Inc/Canada ∞	– –
KRW	14 Samsung Electronics Co Ltd	2.103 1,08	Summe Optionsscheine (Anschaffungskosten – \$)		
	49 SK Telecom Co Ltd ADR	1.489 0,77			
		3.592 1,85	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 186.517 \$)	192.610 99,15	
Spanien – 1,72 % (28. Februar 2025: 1,80 %)			Devisenterminkontrakte – 0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
EUR	265 Banco Santander SA	3.338 1,72	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	11 0,01	
Schweden – 1,36 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	192.621 99,16	
SEK	60 Sandvik AB	2.644 1,36	Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Taiwan – 4,20 % (28. Februar 2025: 1,88 %)			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-11 -0,01	
TWD	17 MediaTek Inc	1.042 0,53	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-11 -0,01	
TWD	114 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	7.123 3,67	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	192.610 99,15	
		8.165 4,20	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	1.643 0,85	
Vereinigtes Königreich – 4,44 % (28. Februar 2025: 5,00 %)			Gesamt Nettovermögen	194.253 \$ 100,00	
GBP	201 HSBC Holdings Plc	3.761 1,94	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
GBP	393 Tesco Plc	2.545 1,31	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 1.102.000 \$ und machten 0,57 % des Nettovermögens aus.		
GBP	31 Unilever Plc	2.313 1,19	∞ Das Wertpapier wurde vom Bewertungsausschuss in gutem Glauben zum beizulegenden Zeitwert oder nach seinem freiem Ermessen bewertet.		
		8.619 4,44			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
AUD	– Australischer Dollar
CAD	– Kanadischer Dollar
CHF	– Schweizer Franken
EUR	– Euro
GBP	– Britisches Pfund Sterling
HKD	– Hongkong-Dollar
IDR	– Indonesische Rupiah
JPY	– Japanischer Yen
KRW	– Südkoreanischer Won
SEK	– Schwedische Kronen
TWD	– Taiwanesischer Dollar

	% des Gesamt- vermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	98,18
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	1,81
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	18	Verkauf	EUR	15	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	15	Verkauf	EUR	13	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	–	Verkauf	SEK	4	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	7	Verkauf	SEK	59	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	2	Verkauf	SGD	3	–
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	1.772	Verkauf	USD	1.403	-1
13. März 2026	BNY	Kauf	SEK	350	Verkauf	USD	39	-1
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	95	Verkauf	USD	130	-2
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	612	Verkauf	USD	731	-7
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH	466	Verkauf	USD	68	1
13. März 2026	BNY	Kauf	CHF	21	Verkauf	USD	27	–
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	–	Verkauf	USD	–	–
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD	3.752	Verkauf	USD	2.660	10
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								\$ 11
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								-11
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 96,76 % (28. Februar 2025: 97,82 %)		
Australien – 2,01 % (28. Februar 2025: 1,96 %)		
AUD 4.504 APA Group	24.892	2,01
Belgien – 2,40 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
221 Elia Group SA/NV 'B'	29.735	2,40
Brasilien – 2,85 % (28. Februar 2025: 1,78 %)		
BRL 1.798 Axia Energia	18.214	1,47
BRL 2.456 Equatorial SA	17.071	1,38
	35.285	2,85
Kanada – 9,04 % (28. Februar 2025: 14,25 %)		
CAD 4.016 Algonquin Power & Utilities Corp	23.769	1,92
CAD 387 Canadian National Railway Co	36.757	2,96
CAD 946 TC Energy Corp	51.508	4,16
	112.034	9,04
Frankreich – 12,46 % (28. Februar 2025: 8,14 %)		
307 Aeroports de Paris SA	36.325	2,93
1.178 Engie SA	34.092	2,75
2.240 Getlink SE	41.178	3,32
305 Vinci SA	42.839	3,46
	154.434	12,46
Deutschland – 11,28 % (28. Februar 2025: 6,65 %)		
2.479 E.ON SE	48.858	3,94
612 Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	50.874	4,11
737 RWE AG	40.028	3,23
	139.760	11,28
Italien – 2,57 % (28. Februar 2025: 6,04 %)		
3.128 Terna — Rete Elettrica Nazionale	31.809	2,57
Spanien – 2,97 % (28. Februar 2025: 6,09 %)		
1.382 Aena SME SA, 144A	36.872	2,97
Vereinigtes Königreich – 8,46 % (28. Februar 2025: 7,30 %)		
GBP 1.667 Severn Trent Plc	62.287	5,03
GBP 1.390 SSE Plc	42.526	3,43
	104.813	8,46
USA – 42,72 % (28. Februar 2025: 45,61 %)		
USD 924 Brookfield Renewable Corporation	33.401	2,70
USD 1.260 CenterPoint Energy Inc	46.388	3,74
USD 133 Constellation Energy Corp	37.185	3,00
USD 908 CSX Corp	32.820	2,65
USD 613 Entergy Corp	55.548	4,48
USD 988 Ferrovial SE	62.213	5,02
USD 447 NextEra Energy Inc	35.448	2,86
USD 760 OGE Energy Corp	31.589	2,55
USD 500 ONEOK Inc	35.051	2,83
USD 2.214 PG&E Corp	35.587	2,87
USD 805 Portland General Electric Co	36.739	2,97
USD 301 Public Service Enterprise Group Inc	21.910	1,77
USD 131 Union Pacific Corp	29.357	2,37
USD 571 Williams Cos Inc/The	36.107	2,91
	529.343	42,72
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 1.022.585 €)	1.198.977	96,76
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.022.585 €)	1.198.977	96,76
Devisenterminkontrakte – 0,09 % (28. Februar 2025: 0,02 %)		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	1.119	0,09
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	1.200.096	96,85
Devisenterminkontrakte – -0,03 % (28. Februar 2025: -0,16 %)		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-319	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-319	-0,03
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.199.777	96,82
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte	39.333	3,18
Gesamtnettovermögen	1.239.110 €	100,00

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	93,27
Finanzderivate	0,09
Sonstige Vermögenswerte	6,64
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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 36.872.000 € und machten 2,97 % des Nettovermögens aus.

[^] 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 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
03. März 2026	BNY	Kauf	EUR 1.106	Verkauf	BRL 6.710	€ -2	
03. März 2026	BNY	Kauf	BRL 6.709	Verkauf	EUR 1.075	32	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 68	Verkauf	AUD 115	-	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 2	Verkauf	AUD 3	-	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 149	Verkauf	CNH 1.218	-2	
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 8.550	Verkauf	EUR 5.676	44	
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 400	Verkauf	EUR 270	-1	
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH 88.395	Verkauf	EUR 10.741	166	
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH 3.405	Verkauf	EUR 421	-1	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 1.980	Verkauf	EUR 1.679	-3	
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 2	Verkauf	EUR 2	-	
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 2.943	Verkauf	EUR 1.750	22	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 96.204	Verkauf	EUR 80.669	697	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 221	Verkauf	SGD 331	-2	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 13	Verkauf	SGD 20	-	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 1.261	Verkauf	USD 1.488	2	
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 673	Verkauf	USD 800	-3	
25. März 2026	BNY	Kauf	GBP 71	Verkauf	AUD 135	-1	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 2.212	Verkauf	AUD 2.284	-2	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 1.584	Verkauf	AUD 2.644	-6	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 14	Verkauf	AUD 23	-	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 54	Verkauf	BRL 328	-	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 1.827	Verkauf	BRL 11.295	-22	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 84	Verkauf	BRL 317	-	
25. März 2026	BNY	Kauf	GBP 80	Verkauf	BRL 567	-1	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 2.441	Verkauf	BRL 9.339	-16	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 5.584	Verkauf	CAD 9.024	-13	
25. März 2026	BNY	Kauf	AUD 498	Verkauf	CAD 479	3	
25. März 2026	BNY	Kauf	GBP 826	Verkauf	CAD 1.524	-6	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 111	Verkauf	CAD 179	-	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 33.863	Verkauf	EUR 20.949	54	
25. März 2026	BNY	Kauf	AUD 543	Verkauf	EUR 324	2	
25. März 2026	BNY	Kauf	GBP 1.562	Verkauf	EUR 1.790	-10	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 8.919	Verkauf	GBP 4.814	50	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 6.346	Verkauf	GBP 5.536	41	
25. März 2026	BNY	Kauf	AUD 30	Verkauf	GBP 16	-	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 22.583	Verkauf	USD 26.883	-138	
25. März 2026	BNY	Kauf	CAD 32.368	Verkauf	USD 23.843	-75	
25. März 2026	BNY	Kauf	EUR 1.922	Verkauf	USD 2.266	5	
25. März 2026	BNY	Kauf	GBP 1.036	Verkauf	USD 1.414	-15	
02. Apr. 2026	BNY	Kauf	BRL 6.949	Verkauf	EUR 1.134	1	
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 158 €)						€ 1.119	
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.213 €)						-319	
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -1.055 €)						€ 800	

[^] 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 2026

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – 95,61 % (28. Februar 2025: 92,50 %)			
Australien: 5,29 % (28. Februar 2025: 3,84 %)			
AUD	2.718 APA Group	17.750	4,24
AUD	1.282 Atlas Arteria Ltd	4.378	1,05
		22.128	5,29
Brasilien – 5,19 % (28. Februar 2025: 1,57 %)			
BRL	768 Axia Energia	9.187	2,20
BRL	4.382 Cia Paranaense de Energia — Copel	12.526	2,99
		21.713	5,19
Kanada – 16,10 % (28. Februar 2025: 16,46 %)			
CAD	148 Canadian National Railway Co	16.629	3,98
CAD	298 Enbridge Inc	15.851	3,79
CAD	499 South Bow Corp	16.033	3,83
CAD	292 TC Energy Corp	18.804	4,50
		67.317	16,10
Frankreich – 13,33 % (28. Februar 2025: 4,51 %)			
EUR	68 Aeroports de Paris SA	9.543	2,28
EUR	636 Engie SA	21.752	5,20
EUR	382 Getlink SE	8.287	1,98
EUR	97 Vinci SA	16.163	3,87
		55.745	13,33
Deutschland – 3,92 % (28. Februar 2025: 5,23 %)			
EUR	703 E.ON SE	16.371	3,92
Italien – 9,09 % (28. Februar 2025: 7,65 %)			
EUR	994 Enav SpA, 144A	6.476	1,55
EUR	1.403 Enel SpA	16.893	4,04
EUR	1.880 Snam SpA	14.633	3,50
		38.002	9,09
Mexiko – 1,34 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			
MXN	156 Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	5.609	1,34
Spanien – 4,13 % (28. Februar 2025: 7,16 %)			
EUR	548 Aena SME SA, 144A	17.273	4,13
Vereinigtes Königreich: 7,33 % (28. Februar 2025: 10,66 %)			
GBP	1.003 Pennon Group Plc	8.106	1,94
GBP	278 Severn Trent Plc	12.256	2,93
GBP	284 SSE Plc	10.271	2,46
		30.633	7,33
USA – 29,89 % (28. Februar 2025: 33,30 %)			
	365 Brookfield Renewable Corporation	15.588	3,73
	313 Clearway Energy Inc 'C'	12.008	2,87
	27 Constellation Energy Corp	8.965	2,14
	121 Edison International	9.031	2,16
	190 Entergy Corp	20.305	4,86
	87 NextEra Energy Inc	8.173	1,96
	215 OGE Energy Corp	10.582	2,53
	82 ONEOK Inc	6.764	1,62
	183 Portland General Electric Co	9.898	2,37
	84 Public Service Enterprise Group Inc	7.195	1,72
	220 Williams Cos Inc/The	16.432	3,93
		124.941	29,89
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 327.710 \$)		399.732	95,61
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 327.710 \$)		399.732	95,61
Devisenterminkontrakte – 0,02 % (28. Februar 2025: 0,07 %)			
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		94	0,02
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		399.826	95,63
Devisenterminkontrakte: -0,08 % (28. Februar 2025: -0,03 %)			
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		-340	-0,08
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		-340	-0,08
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		399.486	95,55
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		18.605	4,45
Gesamt Nettovermögen		418.091 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 23.749.000 \$ und machten 5,68 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

AUD	– Australischer Dollar
BRL	– Brasilianischer Real
CAD	– Kanadischer Dollar
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	88,82
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	11,16
Gesamtvermögen	100,00

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 4	Verkauf	AUD 5	\$	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 307	Verkauf	AUD 437		-2
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 1.129	Verkauf	CNH 7.732		1
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 178	Verkauf	EUR 151		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 36	Verkauf	EUR 31		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 26	Verkauf	GBP 20		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 961	Verkauf	SGD 1.212		1
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 167	Verkauf	SGD 211		–
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 71.679	Verkauf	USD 56.780		-57
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 728	Verkauf	USD 575		2
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 6.651	Verkauf	USD 9.095		-133
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 10	Verkauf	USD 13		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 4.609	Verkauf	USD 5.439		12
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH 2.132	Verkauf	USD 312		–
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH 52.526	Verkauf	USD 7.611		51
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 9.509	Verkauf	USD 6.740		27
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 312	Verkauf	USD 222		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 14.541	Verkauf	USD 17.339		-148
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 198 \$)						\$	94
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -69 \$)							-340
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 129 \$)						\$	-246

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	% des Gesamtvermögens
Stammaktien – 93,55 % (28. Februar 2025: 91,31 %)				
Kanada – 3,12 % (28. Februar 2025: 1,94 %)				
CAD	4 Teck Resources Ltd	264	3,12	
Frankreich – 7,75 % (28. Februar 2025: 8,27 %)				
EUR	4 Bureau Veritas SA	144	1,70	
EUR	1 Nexans SA	203	2,41	
EUR	4 TotalEnergies SE	308	3,64	
		655	7,75	
Deutschland – 10,17 % (28. Februar 2025: 8,12 %)				
EUR	1 Gerresheimer AG	23	0,28	
EUR	1 Merck KGaA	170	2,02	
EUR	1 Siemens AG	293	3,46	
EUR	2 Siemens Energy AG	373	4,41	
		859	10,17	
Japan – 3,42 % (28. Februar 2025: 3,36 %)				
JPY	9 Hitachi Ltd	290	3,42	
Spanien – 4,28 % (28. Februar 2025: 4,48 %)				
EUR	16 Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	362	4,28	
Vereinigtes Königreich – 18,00 % (28. Februar 2025: 15,06 %)				
GBP	1 AstraZeneca Plc	305	3,62	
GBP	8 Compass Group Plc	237	2,80	
GBP	197 Lloyds Banking Group Plc	269	3,19	
GBP	16 National Grid Plc	308	3,64	
GBP	3 Unilever Plc	247	2,92	
GBP	8 United Utilities Group Plc	155	1,83	
		1.521	18,00	
USA – 46,81 % (28. Februar 2025: 46,99 %)				
	1 Alphabet Inc 'A'	347	4,11	
	3 American International Group Inc	208	2,46	
	4 Brookfield Renewable Corporation	171	2,02	
	3 Charles Schwab Corp/The	317	3,75	
	17 CNH Industrial NV	207	2,45	
	3 CVS Health Corp	219	2,59	
	5 EQT Corp	276	3,27	
	3 Fortune Brands Innovations Inc	175	2,06	
	1 Johnson & Johnson	278	3,29	
	2 Johnson Controls International plc	256	3,03	
	– Meta Platforms Inc 'A'	138	1,63	
	3 Microchip Technology Inc	189	2,23	
	1 Nestle SA ADR	147	1,74	
	3 NextEra Energy Inc	248	2,94	
	– Oracle Corp	72	0,86	
	1 Vertiv Holdings Co 'A'	174	2,05	
	2 Walt Disney Co/The	207	2,45	
	4 Wells Fargo & Co	328	3,88	
		3.957	46,81	
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 5.307 \$)		7.908	93,55	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 5.307 \$)		7.908	93,55	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		7.908	93,55	
Devisenterminkontrakte – -0,01 % (28. Februar 2025: 0,00 %)				
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		–	-0,01	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		–	-0,01	
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		7.908	93,54	
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		545	6,46	
Gesamtneutrovermögen		8.453 \$	100,00	

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

ABKÜRZUNGEN:

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	21	Verkauf	USD	16	\$	–
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	13	Verkauf	USD	18		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	15	Verkauf	USD	18		–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)									–
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)								\$	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 4,94 % (28. Februar 2025: 3,37 %)					
53.733 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	53.733	4,94	340 NCR Voyix Corp	2.596	0,24
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 53.733 \$)	53.733	4,94	133 PAR Technology Corp	2.179	0,20
Stammaktien – 95,18 % (28. Februar 2025: 96,66 %)			94 Parsons Corp	6.206	0,57
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 3,94 % (28. Februar 2025: 3,82 %)			291 Stratysys Ltd	2.802	0,26
68 AAR Corp	8.026	0,74		37.580	3,46
98 Astronics Corp	7.855	0,72	Kosmetik u. Körperpflege – 0,49 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
46 ATI Inc	7.593	0,70	58 elf Beauty Inc	5.309	0,49
41 Ducommun Inc	5.039	0,46	Distribution u. Großhandel – 2,56 % (28. Februar 2025: 2,53 %)		
132 Leonardo DRS Inc	5.722	0,53	230 Resideo Technologies Inc	8.879	0,82
97 Mercury Systems Inc	8.657	0,79	37 SiteOne Landscape Supply Inc	5.258	0,48
	42.892	3,94	200 Titan Machinery Inc	3.894	0,36
Bekleidung – 1,11 % (28. Februar 2025: 1,16 %)			22 VSE Corp	4.905	0,45
137 Capri Holdings Ltd	2.803	0,26	17 WESCO International Inc	4.849	0,45
133 Carter's Inc	4.455	0,41		27.785	2,56
18 Kontoor Brands Inc	1.187	0,11	Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 3,91 % (28. Februar 2025: 3,73 %)		
398 Lakeland Industries Inc	3.642	0,33	61 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	2.466	0,23
	12.087	1,11	CAD 676 Canaccord Genuity Group Inc	6.620	0,61
Automobilhersteller – 0,08 % (28. Februar 2025: 0,40 %)			85 Encore Capital Group Inc	5.804	0,53
83 Wabash National Corp	844	0,08	11 Evercore Inc 'A'	3.472	0,32
Autoteile u. Ausstattung – 1,44 % (28. Februar 2025: 1,75 %)			132 Marex Group Plc	5.730	0,53
134 Fox Factory Holding Corp	2.265	0,21	78 Moelis & Co 'A'	4.600	0,42
211 Gentherm Inc	6.890	0,63	354 Perella Weinberg Partners 'A'	6.547	0,60
889 indie Semiconductor Inc	3.266	0,30	106 Victory Capital Holdings Inc 'A'	7.307	0,67
330 Titan International Inc	3.209	0,30		42.546	3,91
	15.630	1,44	Strom – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Banken – 4,72 % (28. Februar 2025: 4,18 %)			207 Ameresco Inc 'A'	6.319	0,58
167 BankUnited Inc	7.780	0,72	Elektrische Komponenten u. Zubehör – 0,86 % (28. Februar 2025: 1,46 %)		
212 BayCom Corp	6.246	0,57	129 American Superconductor Corp	4.217	0,39
247 Business First Bancshares Inc	6.739	0,62	92 nLight Inc	5.176	0,47
55 Customers Bancorp Inc	3.735	0,34		9.393	0,86
177 Dime Community Bancshares Inc	5.714	0,53	Elektronik – 3,83 % (28. Februar 2025: 4,61 %)		
138 Hilltop Holdings Inc	5.161	0,47	18 Advanced Energy Industries Inc	5.952	0,55
245 Seacoast Banking Corp of Florida	7.628	0,70	141 Applied Optoelectronics Inc	11.851	1,09
121 Towne Bank/Portsmouth VA	4.146	0,38	793 Comtech Telecommunications Corp	3.976	0,37
91 Walker & Dunlop Inc	4.196	0,39	119 CTS Corp	6.258	0,57
	51.345	4,72	539 Identiv Inc	1.719	0,16
Biotechnologie – 0,70 % (28. Februar 2025: 0,52 %)			278 Knowles Corp	7.554	0,69
103 Certara Inc	727	0,07	1.962 Kopin Corp	4.347	0,40
265 Innoviva Inc	6.087	0,56		41.657	3,83
164 Myriad Genetics Inc	759	0,07	Energie – Alternative Quellen – 0,37 % (28. Februar 2025: 0,12 %)		
	7.573	0,70	681 Shoals Technologies Group Inc 'A'	4.036	0,37
Baumaterialien – 3,57 % (28. Februar 2025: 0,95 %)			Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 3,41 % (28. Februar 2025: 3,13 %)		
89 Apogee Enterprises Inc	3.527	0,32	320 Concrete Pumping Holdings Inc	2.158	0,20
285 Aspen Aerogels Inc	891	0,08	34 Construction Partners Inc 'A'	4.615	0,42
44 Boise Cascade Co	3.627	0,33	62 Limbach Holdings Inc	5.688	0,52
102 Gibraltar Industries Inc	4.630	0,43	603 Mistras Group Inc	9.223	0,85
218 LSI Industries Inc	4.706	0,43	684 Orion Group Holdings Inc	9.378	0,86
35 Modine Manufacturing Co	8.036	0,74	40 Primoris Services Corp	6.034	0,56
101 NWPX Infrastructure Inc	7.782	0,72		37.096	3,41
899 SmartRent Inc	1.361	0,12	Unterhaltung – 1,77 % (28. Februar 2025: 1,50 %)		
104 Trex Co Inc	4.314	0,40	108 IMAX Corp	4.606	0,42
	38.874	3,57	792 Lionsgate Studios Corp	7.131	0,65
Chemie – 0,96 % (28. Februar 2025: 1,05 %)			143 Pursuit Attractions and Hospitality Inc	4.979	0,46
100 Ingevity Corp	7.202	0,66	235 Starz Entertainment Corp	2.581	0,24
89 Intrepid Potash Inc	3.288	0,30		19.297	1,77
	10.490	0,96	Umweltkontrolle – 1,42 % (28. Februar 2025: 1,05 %)		
Gewerbliche Dienstleistungen – 6,22 % (28. Februar 2025: 4,97 %)			729 Arq Inc	2.561	0,24
168 American Public Education Inc	7.673	0,71	132 CECO Environmental Corp	7.981	0,73
194 AMN Healthcare Services Inc	3.773	0,35	167 Montrose Environmental Group Inc	4.875	0,45
352 Arlo Technologies Inc	5.531	0,51		15.417	1,42
68 Euronet Worldwide Inc	4.726	0,43	Hand-/Maschinenwerkzeuge – 0,58 % (28. Februar 2025: 0,68 %)		
1.344 FTAI Infrastructure Inc	7.804	0,72	491 Luxfer Holdings Plc	6.323	0,58
207 Healthcare Services Group Inc	4.508	0,41	Gesundheit – Produkte – 3,88 % (28. Februar 2025: 3,71 %)		
515 NPK International Inc	7.417	0,68	572 AngioDynamics Inc	6.536	0,60
259 Public Policy Holding Co Inc	3.000	0,28	470 Apyx Medical Corp	1.537	0,14
173 Robert Half Inc	4.227	0,39	94 Artivion Inc	3.625	0,33
184 Spire Global Inc	1.630	0,15	175 Avanos Medical Inc	2.465	0,23
383 TIC Solutions Inc	3.628	0,33	677 Bioventus Inc	5.960	0,55
51 Transcat Inc	3.969	0,36	236 Ceribell Inc	4.417	0,41
628 TrueBlue Inc	2.660	0,24	93 DENTSPLY SIRONA Inc	1.369	0,13
197 Universal Technical Institute Inc	7.149	0,66	320 Tandem Diabetes Care Inc	8.101	0,74
	67.695	6,22	30 Teleflex Inc	3.702	0,34
Computer – 3,46 % (28. Februar 2025: 4,55 %)			343 Varex Imaging Corp	4.516	0,41
245 Amentum Holdings Inc	7.332	0,67		42.228	3,88
494 CI&T Inc	2.456	0,23	Gesundheit – Dienstleistungen – 2,27 % (28. Februar 2025: 1,56 %)		
25 EPAM Systems Inc	3.573	0,33	175 Astrana Health Inc	3.557	0,33
380 Grid Dynamics Holdings Inc	2.578	0,24	191 Concentra Group Holdings Parent Inc	4.576	0,42
177 NCR Atleos Corp	7.858	0,72	300 Privia Health Group Inc	7.113	0,65
			60 RadNet Inc	4.219	0,39

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Stammaktien – (Fortsetzung)					
Gesundheit – Dienstleistungen – (Fortsetzung)					
204 Select Medical Holdings Corp	3.057	0,28	301 CorMedix Inc	2.144	0,20
495 Strata Critical Medical Inc	2.121	0,20	117 Harrow Inc	6.351	0,58
	24.643	2,27		8.495	0,78
Bauunternehmen – 0,99 % (28. Februar 2025: 3,40 %)					
63 Champion Homes Inc	5.892	0,54	Einzelhandel – 4,32 % (28. Februar 2025: 3,55 %)		
122 Winnebago Industries Inc	4.854	0,45	57 Abercrombie & Fitch Co	5.608	0,52
	10.746	0,99	165 Advance Auto Parts Inc	8.779	0,81
Wohnungseinrichtungen – 0,35 % (28. Februar 2025: 0,09 %)			203 Camping World Holdings Inc 'A'	1.685	0,15
247 Sonos Inc	3.803	0,35	9 Dillard's Inc	5.604	0,52
Versicherung – 0,96 % (28. Februar 2025: 0,47 %)			293 J Jill Inc	5.058	0,46
709 Abacus Global Management Inc	6.468	0,59	228 MarineMax Inc	6.972	0,64
244 Kingstone Cos Inc	4.015	0,37	206 OneWater Marine Inc 'A'	2.340	0,21
	10.483	0,96	25 RH	4.111	0,38
Internet – 1,69 % (28. Februar 2025: 3,89 %)			109 Victoria's Secret & Co	6.842	0,63
253 Crexendo Inc	1.478	0,14		46.999	4,32
156 IAC Inc	5.972	0,55	Sparen u. Kredite – 0,69 % (28. Februar 2025: 0,24 %)		
449 LifeMD Inc	1.202	0,11	52 Axos Financial Inc	4.523	0,42
226 Magnite Inc	3.084	0,28	165 OceanFirst Financial Corp	2.987	0,27
382 OptimizeRx Corp	2.898	0,27		7.510	0,69
316 QuinStreet Inc	3.702	0,34	Halbleiter – 6,64 % (28. Februar 2025: 5,25 %)		
	18.336	1,69	163 Alpha & Omega Semiconductor Ltd	3.427	0,31
Eisen/Stahl – 0,40 % (28. Februar 2025: 1,85 %)			107 Amkor Technology Inc	5.117	0,47
60 Commercial Metals Co	4.398	0,40	49 Axcels Technologies Inc	4.043	0,37
Maschinen – Bau u. Bergbau – 0,43 % (28. Februar 2025: 0,70 %)			281 Cohu Inc	8.473	0,78
294 Babcock & Wilcox Enterprises Inc	2.606	0,24	66 FormFactor Inc	6.507	0,60
10 BWX Technologies Inc	2.048	0,19	401 inTEST Corp	4.682	0,43
	4.654	0,43	40 IPG Photonics Corp	5.308	0,49
Maschinen – Diversifiziert – 1,64 % (28. Februar 2025: 2,01 %)			48 Kulicke & Soffa Industries Inc	3.338	0,31
404 Aebi Schmidt Holding AG	5.843	0,54	327 Penguin Solutions Inc	6.799	0,62
98 Cactus Inc 'A'	5.299	0,48	49 Silicon Motion Technology Corp ADR	6.279	0,58
142 Ichor Holdings Ltd	6.730	0,62	131 Ultra Clean Holdings Inc	7.925	0,73
	17.872	1,64	223 Veeco Instruments Inc	6.814	0,63
Metallherstellung u. -elemente – 1,72 % (28. Februar 2025: 2,32 %)			75 Vishay Precision Group Inc	3.475	0,32
72 Helios Technologies Inc	5.135	0,47		72.187	6,64
347 Janus International Group Inc	2.412	0,22	Software – 3,54 % (28. Februar 2025: 3,86 %)		
326 Mayville Engineering Co Inc	6.839	0,63	562 ACV Auctions Inc	2.730	0,25
257 Metallus Inc	4.362	0,40	248 Alignment Healthcare Inc	4.783	0,44
	18.748	1,72	641 Blend Labs Inc	1.074	0,10
Bergbau – 2,31 % (28. Februar 2025: 1,36 %)			170 Digi International Inc	8.304	0,76
369 Almonty Industries Inc	6.782	0,63	233 I3 Verticals Inc 'A'	5.228	0,48
CAD 709 Capstone Copper Corp	7.325	0,67	129 LiveRamp Holdings Inc	3.514	0,32
534 Ferroglobe Plc	2.738	0,25	472 Sophia Genetics SA	2.126	0,20
CAD 618 Major Drilling Group International Inc	8.255	0,76	957 Talkspace Inc	4.609	0,42
	25.100	2,31	525 Veritone Inc	1.478	0,14
Fertigung diverse – 1,23 % (28. Februar 2025: 1,27 %)			458 Viant Technology Inc	4.650	0,43
EUR 124 AMG Critical Materials NV	4.912	0,45		38.496	3,54
52 Materion Corp	8.409	0,78	Telekommunikation – 3,66 % (28. Februar 2025: 3,74 %)		
	13.321	1,23	368 A10 Networks Inc	7.094	0,65
Öl u. Gas – 2,20 % (28. Februar 2025: 3,16 %)			681 ADTRAN Holdings Inc	6.946	0,64
200 Comstock Resources Inc	3.921	0,36	318 Aviat Networks Inc	7.976	0,73
68 Matador Resources Co	3.504	0,32	335 Gilat Satellite Networks Ltd	5.320	0,49
113 Northern Oil & Gas Inc	3.119	0,29	351 Inseego Corp	4.340	0,40
55 Range Resources Corp	2.250	0,21	222 Lantronix Inc	1.324	0,12
409 SandRidge Energy Inc	7.171	0,66	937 Powerfleet Inc NJ	3.350	0,31
CAD 364 Vermilion Energy Inc	3.922	0,36	1.561 Ribbon Communications Inc	3.504	0,32
	23.887	2,20		39.854	3,66
Öl- u. Gasdienstleistungen – 5,98 % (28. Februar 2025: 6,03 %)			Transportwesen – 3,20 % (28. Februar 2025: 2,62 %)		
142 Archrock Inc	5.014	0,46	123 Ardmore Shipping Corp	2.018	0,19
603 DNOW Inc	7.105	0,65	135 Hub Group Inc 'A'	5.803	0,53
173 Flotek Industries Inc	2.656	0,24	292 Marten Transport Ltd	3.965	0,37
197 Flowco Holdings Inc	4.443	0,41	337 Navigator Holdings Ltd	7.089	0,65
158 Kodiak Gas Services Inc	8.599	0,79	315 Proficient Auto Logistics Inc	2.389	0,22
309 Liberty Energy Inc 'A'	8.692	0,80	738 Radiant Logistics Inc	5.476	0,50
317 Ranger Energy Services Inc	5.531	0,51	205 RXO Inc	3.273	0,30
707 Select Water Solutions Inc 'A'	9.658	0,89	137 Werner Enterprises Inc	4.801	0,44
135 Solaris Energy Infrastructure Inc 'A'	6.718	0,62		34.814	3,20
766 TETRA Technologies Inc	6.626	0,61	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 838.573 \$)		
	65.042	5,98		1.035.267	95,18
Verpackung u. Behälter – 0,32 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 892.306 \$)		
677 Ranpak Holdings Corp 'A'	3.463	0,32		1.089.000	100,12
			Devisenterminkontrakte: 0,01 % (28. Februar 2025: 0,09 %)		
			Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
				92	0,01
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
				1.089.092	100,13
			Devisenterminkontrakte: -0,12 % (28. Februar 2025: -0,01 %)		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-1.239	-0,12
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-1.239	-0,12

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	1.087.853	100,01
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-193	-0,01
Gesamt Nettovermögen	1.087.660 \$	100,00

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR	– American Depositary Receipt
CAD	– Kanadischer Dollar
EUR	– Euro

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,64
Organismen für gemeinsame Anlagen	4,91
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,44
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
03. März 2026	BNY	Kauf	USD 1.451	Verkauf	BRL 7.474	\$ -7
03. März 2026	BNY	Kauf	BRL 7.474	Verkauf	USD 1.433	25
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 79	Verkauf	AUD 111	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 324	Verkauf	AUD 458	-2
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 844	Verkauf	EUR 716	-2
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 1.175	Verkauf	EUR 992	4
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 580	Verkauf	PLN 2.063	2
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 26	Verkauf	SEK 235	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 2	Verkauf	SEK 12	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 9	Verkauf	SGD 11	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD 403	Verkauf	SGD 509	–
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP 104	Verkauf	USD 142	-2
13. März 2026	BNY	Kauf	PLN 21.727	Verkauf	USD 6.151	-71
13. März 2026	BNY	Kauf	SEK 249	Verkauf	USD 28	–
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 20.682	Verkauf	USD 16.381	-16
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD 8.329	Verkauf	USD 6.581	10
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 110	Verkauf	USD 79	–
13. März 2026	BNY	Kauf	AUD 8.828	Verkauf	USD 6.258	26
13. März 2026	BNY	Kauf	CNH 3.976	Verkauf	USD 576	4
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 5.424	Verkauf	USD 6.396	15
13. März 2026	BNY	Kauf	SEK 4.513	Verkauf	USD 506	-5
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR 111.298	Verkauf	USD 132.733	-1.134
02. Apr. 2026	BNY	Kauf	BRL 7.431	Verkauf	USD 1.431	6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 894 \$)						\$ 92
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): -154 \$)						-1.239
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 740 \$)						\$ -1.147

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,04 % (28. Februar 2025: 4,04 %)			Bergbau – 0,88 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
9 iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	1.813	2,02	7 United States Lime & Minerals Inc	786	0,88
49 State Street SPDR Portfolio S&P 600 Small Cap ETF – ETF	2.477	2,76	Fertigung diverse – 5,49 % (28. Februar 2025: 5,08 %)		
2.023 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	2.023	2,26	7 Enpro Inc	1.900	2,12
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 6.162 \$)			16 JBT Marel Corp	2.484	2,77
Stammaktien – 92,60 % (28. Februar 2025: 96,52 %)			24 Myers Industries Inc	532	0,60
Autoteile u. Ausstattung – 2,97 % (28. Februar 2025: 3,58 %)				4.916	5,49
1 Dorman Products Inc	170	0,19	Öl- u. Gasdienstleistungen – 0,85 % (28. Februar 2025: 1,71 %)		
11 Miller Industries Inc/TN	459	0,51	CAD 84 Pason Systems Inc	763	0,85
21 Visteon Corp	2.034	2,27	Pharma – 3,00 % (28. Februar 2025: 2,93 %)		
	2.663	2,97	117 Catalyst Pharmaceuticals Inc	2.688	3,00
Biotechnologie – 0,84 % (28. Februar 2025: 0,98 %)			Immobilien – 1,72 % (28. Februar 2025: 6,13 %)		
84 Zevra Therapeutics Inc	753	0,84	84 Kennedy-Wilson Holdings Inc	913	1,02
Baumaterialien – 2,33 % (28. Februar 2025: 0,56 %)			24 Marcus & Millichap Inc	626	0,70
9 Aeon Inc	861	0,96		1.539	1,72
9 Stella-Jones Inc	630	0,70	Halbleiter – 9,49 % (28. Februar 2025: 8,78 %)		
14 Trex Co Inc	596	0,67	14 Cirrus Logic Inc	1.909	2,13
	2.087	2,33	76 Cohu Inc	2.286	2,55
Chemie – 2,82 % (28. Februar 2025: 3,14 %)			7 FormFactor Inc	650	0,73
17 Quaker Chemical Corp	2.530	2,82	10 MKS Inc	2.396	2,67
Gewerbliche Dienstleistungen – 6,42 % (28. Februar 2025: 8,67 %)			6 Onto Innovation Inc	1.265	1,41
16 Cass Information Systems Inc	731	0,81		8.506	9,49
44 Korn Ferry	2.739	3,06	Software – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
60 Valvoline Inc	2.285	2,55	– CCC Intelligent Solutions Holdings Inc	2	–
	5.755	6,42	Transportwesen – 3,82 % (28. Februar 2025: 0,97 %)		
Computer – 2,62 % (28. Februar 2025: 1,08 %)			6 Landstar System Inc	968	1,08
18 Crane NXT Co	855	0,95	10 Matson Inc	1.623	1,81
20 Maximus Inc	1.494	1,67	2 Saia Inc	829	0,93
	2.349	2,62		3.420	3,82
Kosmetik u. Körperpflege – 2,24 % (28. Februar 2025: 2,09 %)			Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 68.647 \$)		
20 Interparfums Inc	2.012	2,24		82.989	92,60
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 4,99 % (28. Februar 2025: 7,22 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 74.809 \$)		
6 Air Lease Corp 'A'	395	0,44		89.302	99,64
43 Artisan Partners Asset Management Inc 'A'	1.737	1,94	Devisenterminkontrakte – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
1 Evercore Inc 'A'	336	0,37	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
40 Lazard Inc 'A'	2.003	2,24		–	–
	4.471	4,99	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
Elektronik – 9,31 % (28. Februar 2025: 10,17 %)				89.302	99,64
31 Atmos Filtration Technologies Inc	2.004	2,23	Devisenterminkontrakte – -0,02 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
20 Brady Corp 'A'	1.803	2,01	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
11 ESCO Technologies Inc	3.097	3,46		-14	-0,02
53 Knowles Corp	1.444	1,61	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	8.348	9,31		-14	-0,02
Hoch-/Tiefbau u. Bauwesen – 5,59 % (28. Februar 2025: 3,73 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
24 Arcosa Inc	2.589	2,89		89.288	99,62
33 Exponent Inc	2.425	2,70	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	5.014	5,59		334	0,38
Gesundheit – Produkte – 6,36 % (28. Februar 2025: 9,02 %)			Gesamt Nettovermögen		
37 Bio-Techne Corp	2.195	2,45		89.622 \$	100,00
32 Enovis Corp	817	0,91	ABKÜRZUNGEN:		
92 Envista Holdings Corp	2.689	3,00			
	5.701	6,36			
Bauunternehmen – 7,34 % (28. Februar 2025: 5,78 %)			CAD	–	Kanadischer Dollar
14 Champion Homes Inc	1.267	1,41	ETF	–	Börsengehandelter Fonds
17 LCI Industries	2.200	2,46	SPDR	–	Standard & Poor's Depository Receipts.
22 M/I Homes Inc	3.112	3,47	Verteilung des Gesamtvermögens		
	6.579	7,34	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem		
Haushaltswaren u. -artikel – 1,52 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			regulierten Markt gehandelt werden		
6 WD-40 Co	1.358	1,52	Organismen für gemeinsame Anlagen		
Versicherung – 4,41 % (28. Februar 2025: 3,99 %)			Finanzderivate		
39 RLI Corp	2.421	2,70	Sonstige Vermögenswerte		
19 Skyward Specialty Insurance Group Inc	876	0,98	Gesamtvermögen		
– White Mountains Insurance Group Ltd	651	0,73			
	3.948	4,41			
Freizeit – 1,55 % (28. Februar 2025: 1,44 %)					
17 Brunswick Corp.DE	1.388	1,55			
Maschinen – Diversifiziert – 6,04 % (28. Februar 2025: 3,02 %)					
2 Alamo Group Inc	471	0,53			
17 Esab Corp	2.115	2,36			
8 Kadant Inc	2.827	3,15			
	5.413	6,04			

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)			Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	102	Verkauf	EUR	87	\$	–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	EUR	2		–
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	2	Verkauf	SEK	21		–
13. März 2026	BNY	Kauf	SEK	27	Verkauf	USD	2		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	247	Verkauf	USD	291		–
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	1.341	Verkauf	USD	1.598		-14
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 2 \$)								\$	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): – \$)									-14
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten (28. Februar 2025 (in Tsd.): 2 \$)								\$	-14

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,03 % (28. Februar 2025: 2,82 %)		
157 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	157	3,03
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 157 \$)	157	3,03
Stammaktien – 98,05 % (28. Februar 2025: 98,99 %)		
Australien – 2,38 % (28. Februar 2025: 4,83 %)		
AUD – Cochlear Ltd	53	1,03
AUD 19 Hansen Technologies Ltd	70	1,35
	123	2,38
Kanada – 7,21 % (28. Februar 2025: 6,35 %)		
CAD 2 CAE Inc	52	1,00
1 Colliers International Group Inc	94	1,82
1 FirstService Corp	140	2,71
1 RB Global Inc	87	1,68
	373	7,21
Frankreich – 4,58 % (28. Februar 2025: 4,49 %)		
EUR 2 Antin Infrastructure Partners SA	24	0,46
EUR – Gaztransport Et Technigaz SA	112	2,16
EUR 1 Lectra	28	0,54
EUR – Robertet SA	73	1,42
	237	4,58
Deutschland – 1,51 % (28. Februar 2025: 1,83 %)		
EUR 1 CTS Eventim AG & Co KGaA	78	1,51
Indien – 1,95 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
INR 1 AIA Engineering Ltd	51	0,99
INR 9 Triveni Turbine Ltd	50	0,96
	101	1,95
Italien – 2,32 % (28. Februar 2025: 3,24 %)		
EUR 2 Carel Industries SpA, 144A	56	1,09
EUR 1 SOL SpA	64	1,23
	120	2,32
Japan – 12,74 % (28. Februar 2025: 11,27 %)		
JPY 3 BML Inc	83	1,61
JPY 6 Business Engineering Corp	57	1,10
JPY 1 Daiei Kankyo Co Ltd	25	0,48
JPY 2 Dexerials Corp	33	0,64
JPY – Maruwa Co Ltd/Aichi	117	2,26
JPY 1 OBIC Business Consultants Co Ltd	53	1,02
JPY 4 Riken Keiki Co Ltd	95	1,83
JPY 2 TKC Corp	59	1,15
JPY 6 USS Co Ltd	78	1,50
JPY 2 Zuken Inc	59	1,15
	659	12,74
Niederlande – 1,01 % (28. Februar 2025: 0,89 %)		
EUR 1 IMCD NV	52	1,01
Polen – 0,61 % (28. Februar 2025: 1,36 %)		
PLN 1 Asseco Poland SA	31	0,61
Südkorea – 1,39 % (28. Februar 2025: 1,95 %)		
KRW 6 NICE Information Service Co Ltd	72	1,39
Schweden – 1,07 % (28. Februar 2025: 2,00 %)		
SEK 7 Karnov Group AB	55	1,07
Schweiz – 2,75 % (28. Februar 2025: 2,06 %)		
CHF – Accelleron Industries AG	41	0,80
CHF – Kardex Holding AG	47	0,92
CHF – VZ Holding AG	54	1,03
	142	2,75
Vereinigtes Königreich – 11,44 % (28. Februar 2025: 12,25 %)		
GBP 10 Ashtead Technology Holdings plc	58	1,12
GBP 15 Baltic Classifieds Group Plc	38	0,74
GBP 5 CVS Group Plc	91	1,76
GBP 1 Diploma Plc	102	1,98
GBP 11 DiscoverIE Group Plc	97	1,87
GBP 1 Halma Plc	80	1,55
GBP 1 Intertek Group Plc	79	1,52
GBP 8 Rightmove Plc	47	0,90
	592	11,44
USA – 45,28 % (28. Februar 2025: 42,06 %)		
1 AAON Inc	62	1,20
1 Arcosa Inc	92	1,78

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
1 Brady Corp 'A'	65	1,26
1 Brunswick Corp.DE	76	1,48
1 Cognex Corp	47	0,90
1 Dorman Products Inc	62	1,21
– Enpro Inc	53	1,03
1 Esab Corp	98	1,89
– ESCO Technologies Inc	91	1,76
– Evercore Inc 'A'	19	0,37
1 Exponent Inc	95	1,83
– FactSet Research Systems Inc	29	0,57
– Houlihan Lokey Inc 'A'	34	0,66
– Innospec Inc	25	0,48
– Installed Building Products Inc	21	0,41
– Interparfums Inc	44	0,84
1 JBT Marel Corp	107	2,06
– Kadant Inc	55	1,07
1 Knowles Corp	37	0,72
– Landstar System Inc	46	0,89
1 LCI Industries	79	1,53
– Lincoln Electric Holdings Inc	49	0,95
– Littelfuse Inc	106	2,05
– MKS Inc	107	2,08
– Morningstar Inc	59	1,13
– MSA Safety Inc	35	0,68
– Onto Innovation Inc	63	1,21
1 Quaker Chemical Corp	106	2,06
1 RLI Corp	49	0,94
1 SEI Investments Co	87	1,68
– Simpson Manufacturing Co Inc	86	1,67
1 UFP Industries Inc	80	1,55
– Valmont Industries Inc	76	1,47
2 Valvoline Inc	90	1,73
1 Victory Capital Holdings Inc 'A'	62	1,20
– WD-40 Co	49	0,94
	2.341	45,28
Vietnam – 1,81 % (28. Februar 2025: 0,77 %)		
GBP 5 XP Power Ltd	93	1,81
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 4.291 \$)	5.069	98,05
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	5.226	101,08
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	5.226	101,08
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-56	-1,08
Gesamtvermögen	5.170 \$	100,00
– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, betreffen sich entweder auf 0 EUR, weniger als 1.000 EUR, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
144A Wertpapiere, die von der Registrierung gemäß Rule 144A des Securities Act von 1933 in der jeweils gültigen Fassung ausgenommen sind. Diese Wertpapiere dürfen nur bei von einer Registrierung befreiten Transaktionen an qualifizierte institutionelle Anleger weiterverkauft werden. Am 28. Februar 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 56.000 \$ und machten 1,09 % des Nettovermögens aus.		
ABKÜRZUNGEN:		
AUD	– Australischer Dollar	
CAD	– Kanadischer Dollar	
CHF	– Schweizer Franken	
EUR	– Euro	
GBP	– Britisches Pfund Sterling	
INR	– Indische Rupie	
JPY	– Japanischer Yen	
KRW	– Südkoreanischer Won	
PLN	– Polnischer Zloty	
SEK	– Schwedische Kronen	

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	96,72
Organismen für gemeinsame Anlagen	3,00
Sonstige Vermögenswerte	0,28
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 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)	
GBP 54 Evraz Plc †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 313 €)	
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	
Gesamtneuvermögen	

- Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.
- † Nicht liquide.
- μ Mit Wirkung vom 11. Juli 2022 hat der Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ den Handel eingestellt.

ABKÜRZUNGEN:

GBP – Britisches Pfund Sterling

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund[^]_π

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD
Stammaktien – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)	
Russland – 0,00 % (28. Februar 2025: 0,00 %)	
8 Gazprom PJSC ADR †	–
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 54 \$)	–
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	–
Gesamtneutvermögen	– \$

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

† Nicht liquide.

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

ABKÜRZUNGEN:

ADR – American Depositary Receipt

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 2,51 % (28. Februar 2025: 0,02 %)		
510 Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund – Klasse WA (ausschüttend)	510	2,51
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 510 \$)	510	2,51
Stammaktien – 98,87 % (28. Februar 2025: 99,72 %)		
Brasilien – 5,11 % (28. Februar 2025: 5,38 %)		
9 Inter & Co Inc 'A'	80	0,39
BRL 31 Localiza Rent a Car SA	307	1,51
– MercadoLibre Inc	119	0,59
10 NU Holdings Ltd/Cayman Islands	149	0,73
BRL 33 Raia Drogasil SA	160	0,79
BRL 23 WEG SA	222	1,10
	1.037	5,11
Chile – 1,74 % (28. Februar 2025: 1,58 %)		
GBP 6 Antofagasta Plc	352	1,74
China – 20,51 % (28. Februar 2025: 30,57 %)		
HKD 6 Alibaba Group Holding Ltd	102	0,50
4 Alibaba Group Holding Ltd ADR	604	2,98
HKD 14 BYD Co Ltd	164	0,81
55 China Merchants Bank Co Ltd	342	1,69
CNH 7 Contemporary Ampere Technology Co Ltd	324	1,60
CNH 3 Eastroc Beverage Group Co -A	105	0,52
HKD 1 Eastroc Beverage Group Co Ltd	21	0,10
HKD 27 Harbin Electric Co Ltd	97	0,48
HKD 1 JD.com Inc	7	0,04
4 JD.com Inc ADR	96	0,47
HKD 33 Ping An Insurance Group Co of China Ltd	287	1,41
CNH 19 Shenzhen Inovance Technology Co Ltd	205	1,01
CNH 2 Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co.,Ltd.	59	0,29
CNH 13 Sieyuan Electric Co Ltd	396	1,95
HKD 18 Tencent Holdings Ltd	1.169	5,76
3 Trip.com Group Ltd ADR	182	0,90
	4.160	20,51
Hongkong – 1,32 % (28. Februar 2025: 1,77 %)		
HKD 24 AIA Group Ltd	267	1,32
Indien – 14,57 % (28. Februar 2025: 19,91 %)		
INR 4 Apollo Hospitals Enterprise Ltd	326	1,61
INR 56 HDFC Bank Ltd	545	2,69
INR 30 ICICI Bank Ltd	460	2,27
INR 47 Kotak Mahindra Bank Ltd	216	1,06
INR 7 Mahindra & Mahindra Ltd	280	1,38
1 MakeMyTrip Ltd	55	0,27
INR 23 Reliance Industries Ltd	348	1,71
INR 4 Tata Consultancy Services Ltd	126	0,62
INR 8 Titan Co Ltd	383	1,89
INR 2 UltraTech Cement Ltd	216	1,07
	2.955	14,57
Indonesien – 0,75 % (28. Februar 2025: 1,90 %)		
IDR 356 Bank Central Asia Tbk PT	152	0,75
Mexiko – 1,81 % (28. Februar 2025: 1,98 %)		
MXN 20 Grupo Financiero Banorte SAB de CV	224	1,11
MXN 44 Wal-Mart de Mexico SAB de CV	143	0,70
	367	1,81
Polen – 1,62 % (28. Februar 2025: 1,09 %)		
PLN 10 Dino Polska SA, 144A	111	0,55
PLN 8 Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski SA	218	1,07
	329	1,62
Saudi-Arabien – 2,79 % (28. Februar 2025: 3,03 %)		
SAR 10 Al Rajhi Bank	263	1,30
SAR 3 Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	163	0,80
SAR 8 Etihad Etisalat Co	140	0,69
	566	2,79
Südafrika – 4,17 % (28. Februar 2025: 1,87 %)		
ZAR 1 Capitec Bank Holdings Ltd	435	2,14
ZAR 7 Clicks Group Ltd	135	0,67
ZAR 5 Gold Fields Ltd	275	1,36
	845	4,17
Südkorea – 21,55 % (28. Februar 2025: 10,76 %)		
KRW – HD Hyundai Electric Co Ltd	257	1,27
KRW 14 Samsung Electronics Co Ltd	2.162	10,66
KRW 6 Shinhan Financial Group Co Ltd	430	2,12
KRW 2 SK hynix Inc	1.522	7,50
	4.371	21,55

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Taiwan – 22,22 % (28. Februar 2025: 17,91 %)		
TWD 25 Delta Electronics Inc	1.112	5,48
TWD 13 MediaTek Inc	822	4,05
TWD 59 Quanta Computer Inc	546	2,69
TWD 32 Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.028	10,00
	4.508	22,22
USA – 0,71 % (28. Februar 2025: 1,92 %)		
1 EPAM Systems Inc	84	0,42
1 Globant SA	59	0,29
	143	0,71
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 13.999 \$)	20.052	98,87
Vorzugsaktien – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Brasilien – 0,06 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
BRL 1 Localiza Rent a Car SA	11	0,06
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 8 \$)	11	0,06
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	20.573	101,44
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	20.573	101,44
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		
	-292	-1,44
Gesamt Nettovermögen	20.281 \$	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 111.000 \$ und machten 0,55 % des Nettovermögens aus.

ABKÜRZUNGEN:

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

Verteilung des Gesamtvermögens

	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,39
Organismen für gemeinsame Anlagen	2,48
Sonstige Vermögenswerte	0,13
Gesamtvermögen	100,00

[^] 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 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 85,82 % (28. Februar 2025: 92,20 %)			Vereinigtes Königreich – 9,68 % (28. Februar 2025: 12,79 %)		
Australien – 1,76 % (28. Februar 2025: 1,46 %)			1.300 Barclays Plc, 0,877 %, fällig 28.01.2028 *	1.282	1,81
1.300 Macquarie Group Ltd, 0,350 %, fällig 03.03.2028	1.246	1,76	1.200 easyJet FinCo BV, 1,875 %, fällig 03.03.2028	1.186	1,67
Österreich – 0,82 % (28. Februar 2025: 0,68 %)			1.500 National Grid Plc, 0,163 %, fällig 20.01.2028	1.436	2,03
600 BAWAG PSK Bank für Arbeit und Wirtschaft und Oesterreichische Postsparkasse AG, 0,375 %, fällig 03.09.2027	582	0,82	1.400 Nationwide Building Society, 0,250 %, fällig 14.09.2028	1.324	1,87
Belgien – 3,08 % (28. Februar 2025: 2,67 %)			300 Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 2,625 %, fällig 10.09.2028	301	0,43
800 Azelis Finance NV, 5,750 %, fällig 15.03.2028	814	1,15	1.300 Sage Group Plc/The, 3,820 %, fällig 15.02.2028	1.327	1,87
100 Barry Callebaut Services NV, 3,750 %, fällig 19.02.2028	102	0,14		6.856	9,68
1.200 Crelan SA, 5,750 %, fällig 26.01.2028	1.269	1,79			
	2.185	3,08			
China – 1,65 % (28. Februar 2025: 1,37 %)			USA – 15,65 % (28. Februar 2025: 13,47 %)		
1.200 Prosus NV, 1,539 %, fällig 03.08.2028	1.165	1,65	600 Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig 15.07.2028	599	0,85
Tschechische Republik – 0,96 % (28. Februar 2025: 2,36 %)			640 Berry Global Inc, 1,500 %, fällig 15.01.2027	636	0,90
700 Ceska sporitelna AS, 0,500 %, fällig 13.09.2028 *	677	0,96	1.500 Cencora Inc, 2,875 %, fällig 22.05.2028	1.510	2,13
Dänemark – 4,37 % (28. Februar 2025: 4,10 %)			800 Crown European Holdings SACA, 5,000 %, fällig 15.05.2028	839	1,18
1.000 Danske Bank A/S, 4,500 %, fällig 09.11.2028 *	1.033	1,46	1.000 DXC Capital Funding DAC, 0,450 %, fällig 15.09.2027	967	1,36
800 DSV Finance BV, 3,125 %, fällig 06.11.2028	811	1,15	1.100 Goldman Sachs Group Inc/The, 2,000 %, fällig 22.03.2028	1.090	1,54
1.300 Nykredit Realkredit A/S, 0,375 %, fällig 17.01.2028	1.250	1,76	800 IQVIA Inc, 2,250 %, fällig 15.01.2028	789	1,11
	3.094	4,37	1.000 Morgan Stanley, 4,813 %, fällig 25.10.2028 *	1.036	1,46
Frankreich – 16,13 % (28. Februar 2025: 16,87 %)			800 Schneider Electric SE, 1,500 %, fällig 15.01.2028	788	1,11
900 Abertis France SAS, 1,625 %, fällig 27.11.2027	888	1,25	1.200 Thermo Fisher Scientific Inc, 0,500 %, fällig 01.03.2028	1.156	1,63
1.000 Ayvens SA, 3,875 %, fällig 24.01.2028	1.026	1,45	1.000 US Bancorp, 2,824 %, fällig 21.05.2028 *	1.003	1,42
1.200 BPCE SA, 4,375 %, fällig 13.07.2028	1.246	1,76	700 Verizon Communications Inc, 1,375 %, fällig 02.11.2028	677	0,96
1.400 Credit Agricole SA, 0,375 %, fällig 20.04.2028	1.338	1,89		11.090	15,65
1.500 Engie SA, 1,750 %, fällig 27.03.2028	1.479	2,09	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 59.242 €)		
1.300 La Banque Postale SA, 1,000 %, fällig 09.02.2028 *	1.283	1,81		60.808	85,82
1.100 Orano SA, 2,750 %, fällig 08.03.2028	1.105	1,56	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 13,67 % (28. Februar 2025: 6,85 %)		
800 RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 21.09.2028	836	1,18	Frankreich – 4,68 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
900 Rexel SA, 2,125 %, fällig 15.12.2028	888	1,25	3.300 Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 2,400 %, fällig 24.09.2028	3.316	4,68
1.400 Societe Generale SA, 0,125 %, fällig 18.02.2028	1.338	1,89			
	11.427	16,13	Island – 1,43 % (28. Februar 2025: 1,22 %)		
Deutschland – 1,73 % (28. Februar 2025: 2,74 %)			1.000 Internationale Staatsanleihe Island, 3,400 %, fällig 28.06.2027	1.012	1,43
1.200 Commerzbank AG, 4,625 %, fällig 21.03.2028 *	1.226	1,73			
Griechenland – 0,28 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			Rumänien – 2,24 % (28. Februar 2025: 2,06 %)		
200 Piraeus Bank SA, 3,000 %, fällig 03.12.2028 *	201	0,28	1.600 Rumänien, internationale Staatsanleihe, 2,125 %, fällig 07.03.2028	1.584	2,24
Ungarn – 1,44 % (28. Februar 2025: 1,24 %)					
1.000 OTP Bank Nyrt, 4,750 %, fällig 12.06.2028 *	1.022	1,44	Spanien – 5,32 % (28. Februar 2025: 3,57 %)		
Irland – 2,57 % (28. Februar 2025: 2,96 %)			3.500 Spanische Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2028	3.770	5,32
1.000 AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028 *	997	1,41			
800 Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028 *	826	1,16	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 9.550 €)		
	1.823	2,57		9.682	13,67
Italien – 3,94 % (28. Februar 2025: 5,59 %)			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
1.000 Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	984	1,39		70.490	99,49
800 Mundys SpA, 1,875 %, fällig 12.02.2028	787	1,11	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
1.000 Prysmian SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028	1.020	1,44		70.490	99,49
	2.791	3,94	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Japan – 1,06 % (28. Februar 2025: 0,88 %)				361	0,51
800 NTT Finance Corp, 0,399 %, fällig 13.12.2028	754	1,06	Gesamtnettovermögen		
Niederlande – 5,60 % (28. Februar 2025: 4,84 %)				70.851 €	100,00
1.300 ABN AMRO Bank NV, 4,000 %, fällig 16.01.2028	1.336	1,88	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
1.100 Cooperatieve Rabobank UA, 4,625 %, fällig 27.01.2028 *	1.122	1,58			
1.100 ING Groep NV, 4,875 %, fällig 14.11.2027 *	1.119	1,58	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.086.000 € und machten 10,00 % des Nettovermögens aus.		
400 Tennet Netherlands BV, 1,375 %, fällig 05.06.2028	393	0,56	*		
	3.970	5,60	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
Spanien – 5,73 % (28. Februar 2025: 7,44 %)			Verteilung des Gesamtvermögens		
1.000 Banco de Sabadell SA, 5,250 %, fällig 07.02.2029 *	1.047	1,48	Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
1.400 CaixaBank SA, 0,750 %, fällig 26.05.2028 *	1.371	1,93		98,77	
300 Ibercaja Banco SA, 4,375 %, fällig 30.07.2028 *	307	0,43	Sonstige Vermögenswerte		
300 Servicios Financieros Carrefour Establecimiento Financiero de Credito SA, 3,500 %, fällig 29.09.2028	304	0,43		1,23	
1.000 Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027 *	1.033	1,46	Gesamtvermögen		
	4.062	5,73		100,00	
Schweden – 6,12 % (28. Februar 2025: 4,86 %)			– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
1.200 Skandinaviska Enskilda Banken AB, 0,375 %, fällig 21.06.2028	1.142	1,61			
1.000 Svenska Handelsbanken AB, 3,750 %, fällig 01.11.2027	1.022	1,44	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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 7.086.000 € und machten 10,00 % des Nettovermögens aus.		
1.300 Swedbank AB, Series gmntr, 4,250 %, fällig 11.07.2028	1.351	1,91	*		
800 Volvo Car AB, 4,250 %, fällig 31.05.2028	820	1,16	Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
	4.335	6,12	Verteilung des Gesamtvermögens		
Schweiz – 3,25 % (28. Februar 2025: 2,78 %)			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden		
1.000 Cloverie Plc for Zurich Insurance Co Ltd, 1,500 %, fällig 15.12.2028	974	1,38		98,77	
1.300 UBS Group AG, 4,625 %, fällig 17.03.2028 *	1.328	1,87	Sonstige Vermögenswerte		
	2.302	3,25		1,23	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 79,08 % (28. Februar 2025: 92,58 %)			Schweden – 1,91 % (28. Februar 2025: 2,93 %)		
Österreich – 1,12 % (28. Februar 2025: 1,07 %)			400 Swedbank AB, 2,875 %, fällig 30.04.2029		
400 Raiffeisen Bank International AG, 4,625 %, fällig 21.08.2029 *			308 Volvo Car AB, 4,250 %, fällig 31.05.2028		
416 1,12			710 1,91		
Belgien – 2,92 % (28. Februar 2025: 2,77 %)			Schweiz – 1,47 % (28. Februar 2025: 1,45 %)		
150 Azelis Finance NV, 4,750 %, fällig 25.09.2029			500 UBS Group AG, 7,750 %, fällig 01.03.2029 *		
400 Barry Callebaut Services NV, 4,000 %, fällig 14.06.2029			Vereinigtes Königreich – 4,44 % (28. Februar 2025: 8,77 %)		
500 KBC Group NV, 4,250 %, fällig 28.11.2029 *			500 Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 3,625 %, fällig 20.06.2029		
1.088 2,92			514 1,38		
Tschechische Republik – 3,14 % (28. Februar 2025: 2,89 %)			800 Standard Chartered Plc, 0,800 %, fällig 17.11.2029 *		
500 Ceska sporitelna AS, 0,500 %, fällig 13.09.2028 *			760 2,04		
700 Raiffeisenbank AS, 1,000 %, fällig 09.06.2028 *			360 Zegona Finance Plc, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2029		
684 1,84			378 1,02		
1.168 3,14			1.652 4,44		
Dänemark – 5,78 % (28. Februar 2025: 5,50 %)			USA – 13,62 % (28. Februar 2025: 12,05 %)		
500 Danske Bank A/S, 0,750 %, fällig 09.06.2029 *			400 Avantor Funding Inc, 3,875 %, fällig 15.07.2028		
500 ISS Global A/S, 3,875 %, fällig 05.06.2029			522 1,07		
600 Jyske Bank A/S, 4,875 %, fällig 10.11.2029 *			400 Capital One Financial Corp, 1,650 %, fällig 12.06.2029		
500 Nykredit Realkredit A/S, 4,625 %, fällig 19.01.2029			382 1,03		
631 1,69			500 Cencora Inc, 2,875 %, fällig 22.05.2028		
526 1,41			503 1,35		
2.153 5,78			300 Crown European Holdings SACA, 4,750 %, fällig 15.03.2029		
Frankreich – 15,69 % (28. Februar 2025: 20,57 %)			314 0,84		
500 Alstom SA, Nullkupon, fällig 11.01.2029			300 Energizer Gamma Acquisition BV, 3,500 %, fällig 30.06.2029		
465 1,25			293 0,79		
300 Ayvens SA, 4,875 %, fällig 06.10.2028			500 Fidelity National Information Services Inc, 1,000 %, fällig 03.12.2028		
317 0,85			476 1,28		
300 Ayvens SA, 3,875 %, fällig 16.07.2029			500 Goldman Sachs Group Inc/The, 0,875 %, fällig 09.05.2029		
200 Banijay Entertainment SAS, 7,000 %, fällig 01.05.2029			472 1,27		
208 0,56			500 IQVIA Inc, 2,250 %, fällig 15.03.2029		
500 BPCE SA, 3,875 %, fällig 11.01.2029			485 1,30		
515 1,38			600 Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029 *		
500 CNP Assurances SA, 1,250 %, fällig 27.01.2029			623 1,68		
479 1,29			599 1,61		
500 Credit Agricole SA, 0,500 %, fällig 21.09.2029 *			5.069 13,62		
473 1,27			Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 28.729 €)		
600 Credit Mutuel Arkea SA, 3,500 %, fällig 09.02.2029			29.434 79,08		
607 1,63			Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 15,21 % (28. Februar 2025: 5,57 %)		
500 Forvia SE, 5,125 %, fällig 15.06.2029			Frankreich – 3,74 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
516 1,39			500 Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 0,500 %, fällig 25.05.2029		
360 Loxam SAS, 6,375 %, fällig 31.05.2029			473 1,27		
373 1,00			1.000 Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 0,000 %, fällig 25.11.2029		
400 RCI Banque SA, 4,875 %, fällig 02.10.2029			917 2,47		
424 1,14			1.390 3,74		
600 Societe Generale SA, 4,750 %, fällig 28.09.2029 *			Italien – 6,30 % (28. Februar 2025: 3,36 %)		
523 1,40			1.300 Italien, Buoni Poliennali Del Tesoro, Series 5Y, 3,000 %, fällig 01.10.2029		
5.839 15,69			1.328 3,57		
Deutschland – 2,76 % (28. Februar 2025: 5,54 %)			1.000 Italien, Certificati di Credito del Tesoro/ CCTS-eu, Serie EU, 144A, 2,753 %, fällig 15.04.2029 *		
500 Commerzbank AG, 5,250 %, fällig 25.03.2029 *			1.016 2,73		
502 1,35			2.344 6,30		
1.027 2,76			Rumänien – 2,38 % (28. Februar 2025: 2,21 %)		
Griechenland – 0,27 % (28. Februar 2025: 0,00 %)			800 Internationale Staatsanleihe Rumänien, 6,625 %, fällig 27.09.2029		
100 Piraeus Bank SA, 3,000 %, fällig 03.12.2028 *			887 2,38		
100 0,27			Spanien – 2,79 % (28. Februar 2025: 0,00 %)		
Irland – 3,36 % (28. Februar 2025: 3,22 %)			1.000 Spanien, Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 31.05.2029		
400 AIB Group Plc, 5,750 %, fällig 16.02.2029 *			1.039 2,79		
423 1,14			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 5.582 €)		
300 Bank of Ireland Group Plc, 6,625 %, fällig 13.11.2029 *			5.660 15,21		
315 0,85			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
500 Dell Bank International DAC, 3,625 %, fällig 24.06.2029			35.094 94,29		
511 1,37			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
1.249 3,36			35.094 94,29		
Italien – 5,44 % (28. Februar 2025: 6,64 %)			Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
400 Autostrade per l'Italia SpA, 1,875 %, fällig 26.09.2029			2.126 5,71		
418 1,12			Gesamt Nettovermögen		
400 Nexi SpA, 2,125 %, fällig 30.04.2029			37.220 € 100,00		
388 1,04					
400 Prysmian SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028					
408 1,10					
423 1,14					
2.025 5,44					
Luxemburg – 3,63 % (28. Februar 2025: 3,11 %)					
521 Blackstone Property Partners Europe Holdings Sarl, 1,750 %, fällig 12.03.2029					
504 1,36					
450 Logisor Financing Sarl, 4,250 %, fällig 18.07.2029					
469 1,26					
400 SELP Finance Sarl, 0,875 %, fällig 27.05.2029					
377 1,01					
1.350 3,63					
Niederlande – 4,90 % (28. Februar 2025: 4,65 %)					
500 Cooperatieve Rabobank UA, 2,586 %, fällig 16.07.2028 *					
501 1,35					
600 ING Groep NV, 4,500 %, fällig 23.05.2029 *					
623 1,67					
200 Odido Holding BV, 3,750 %, fällig 15.01.2029					
200 0,54					
300 Q-Park Holding I BV, 5,125 %, fällig 01.03.2029					
309 0,83					
200 VZ Vendor Financing II BV, 2,875 %, fällig 15.01.2029					
192 0,51					
1.825 4,90					
Spanien – 8,63 % (28. Februar 2025: 8,99 %)					
400 Abanca Corp Bancaria SA, 5,250 %, fällig 14.09.2028 *					
415 1,12					
500 Banco de Sabadell SA, 5,500 %, fällig 08.09.2029 *					
533 1,43					
500 Banco Santander SA, 0,625 %, fällig 24.06.2029 *					
477 1,28					
400 CaixaBank SA, 5,000 %, fällig 19.07.2029 *					
421 1,13					
300 Ibercaja Banco SA, 4,375 %, fällig 30.07.2028 *					
307 0,83					
200 Kaixo Bondco Telecom SA, 5,125 %, fällig 30.09.2029					
203 0,54					
30 Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027					
30 0,08					
300 Servicios Financieros Carrefour Establecimiento Financiero de Credito SA, 3,500 %, fällig 29.09.2028					
304 0,81					
500 Unicaja Banco SA, 5,125 %, fällig 21.02.2029 *					
524 1,41					
3.214 8,63					

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) EUR	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 90,18 %					
Österreich – 4,14 %					
100 Benteler International AG, 7,250 %, fällig 15.06.2031	107	2,14	100 Ibercaja Banco SA, 4,125 %, fällig 18.08.2036 *	101	2,02
100 Erste Group Bank AG, 3,625 %, fällig 26.11.2035 *	100	2,00	100 Iberdrola Finanzas SA, 3,750 %, Ewige Anleihe *	100	1,99
	207	4,14	100 Telefonica Europe BV, 6,135 %, Ewige Anleihe *	107	2,15
			100 Unicaja Banco SA, 5,500 %, fällig 22.06.2034 *	106	2,12
				414	8,28
Belgien – 2,00 %					
100 Warehouses De Pauw CVA, 3,125 %, fällig 15.01.2031	100	2,00	Vereinigtes Königreich – 4,03 %		
Tschechische Republik – 3,69 %			100 Alexandrite Monnet UK Holdco Plc, 10,500 %, fällig 15.05.2029	107	2,15
100 CPI Property Group SA, 1,500 %, fällig 27.01.2031	84	1,68	100 Vmed O2 UK Financing I Plc, 3,250 %, fällig 31.01.2031	94	1,88
100 Energo - Pro as, 6,450 %, fällig 15.04.2031	101	2,01		201	4,03
	185	3,69	USA – 7,95 %		
Dänemark – 4,06 %			100 Carnival Plc, 4,125 %, fällig 15.07.2031	103	2,06
100 Jyske Bank A/S, 3,500 %, fällig 19.11.2031 *	102	2,03	100 IQVIA Inc, 2,875 %, fällig 15.06.2028	100	1,99
100 Nykredit Realkredit A/S, 3,500 %, fällig 10.07.2031	101	2,03	100 Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, fällig 15.04.2029	99	1,98
	203	4,06	100 WMG Acquisition Corp, 2,250 %, fällig 15.08.2031	96	1,92
Frankreich – 22,07 %				398	7,95
100 Edenred SE, 3,625 %, fällig 13.06.2031	102	2,04	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 4.514 €)		
100 Electricite de France SA, 4,375 %, Ewige Anleihe *	100	2,00		4.511	90,18
100 Engie SA, 1,875 %, Ewige Anleihe *	92	1,84	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 7,92 %		
100 Getlink SE, 4,125 %, fällig 15.04.2030	103	2,05	Chile – 1,78 %		
100 Goldstory SAS, 6,750 %, fällig 01.02.2030	100	2,00	100 Chile, Internationale Staatsanleihe, 0,830 %, fällig 02.07.2031	89	1,78
100 Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement SAS, 3,875 %, fällig 31.01.2031	100	2,00	Côte d'Ivoire (Elfenbeinküste) – 2,03 %		
100 IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 15.06.2031	95	1,91	100 Elfenbeinküste, internationale Staatsanleihe, 5,250 %, fällig 22.03.2030	101	2,03
100 Kapla Holding SAS, 5,000 %, fällig 30.04.2031	102	2,05	Nord-Mazedonien – 1,99 %		
100 New Immo Holding SA, 4,875 %, fällig 08.12.2028	102	2,04	100 Nordmazedonien, Internationale Staatsanleihe, 3,875 %, fällig 21.01.2030	100	1,99
100 Nexans SA, 4,250 %, fällig 11.03.2030	104	2,07	Rumänien – 2,12 %		
100 SNF Group SACA, 4,500 %, fällig 15.03.2032	104	2,07	100 Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 5,375 %, fällig 22.03.2031	106	2,12
	1.104	22,07	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 396 €)		
Deutschland – 4,01 %				396	7,92
100 Dynamo Newco II GmbH, 6,250 %, fällig 15.10.2031	102	2,03	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
100 Volkswagen International Finance NV, 4,375 %, Ewige Anleihe *	99	1,98		4.907	98,10
	201	4,01	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
Griechenland – 2,12 %				4.907	98,10
100 Piraeus Bank SA, 5,375 %, fällig 18.09.2035 *	106	2,12	Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
Ungarn – 2,06 %				96	1,90
100 OTP Bank Nyrt, 4,250 %, fällig 16.10.2030 *	103	2,06	Gesamtneuvermögen		
Italien – 14,13 %				5.003 €	100,00
100 Autostrade per l'Italia SpA, 4,750 %, fällig 24.01.2031	108	2,15	– Beträge, die mit „–“ bezeichnet sind, belaufen sich entweder auf 0 USD, weniger als 1.000 USD, weniger als 1.000 Anteile oder weniger als 0,01 %.		
100 doValue SpA, 5,375 %, fällig 15.11.2031	102	2,04			
100 Iren SpA, 4,500 %, Ewige Anleihe *	102	2,04	* Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.		
100 Mundys SpA, 3,700 %, fällig 29.09.2031	101	2,01			
100 Nexi SpA, 3,875 %, fällig 21.05.2031	100	2,01	ABKÜRZUNGEN:		
100 Prysmian SpA, 3,875 %, fällig 28.11.2031	103	2,06	CPI – Verbraucherpreisindex		
100 X3G Mergeco SpA, 7,000 %, fällig 15.05.2030	91	1,82	Ewige Anleihe – Anleihe ohne Fälligkeitsdatum Ewige Anleihen werden nie getilgt, stattdessen werden unbefristet und regelmäßig Zinsen gezahlt.		
	707	14,13	Verteilung des Gesamtvermögens		
Japan – 1,99 %			Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	97,75	% des Gesamtvermögens
100 SoftBank Group Corp, 5,750 %, fällig 08.07.2032	100	1,99	Sonstige Vermögenswerte	2,25	
Niederlande – 5,58 %			Gesamtvermögen		
100 CTP NV, 1,500 %, fällig 27.09.2031	90	1,80		100,00	
100 Sunrise HoldCo IV BV, 3,875 %, fällig 15.06.2029	100	2,00			
100 Ziggo Bond Co BV, 3,375 %, fällig 28.02.2030	89	1,78			
	279	5,58			
Portugal – 2,05 %					
100 EDP SA, 4,500 %, fällig 27.05.2055 *	102	2,05			
Rumänien – 2,02 %					
100 Banca Comerciala Romana SA, 4,000 %, fällig 25.11.2031 *	101	2,02			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Forderungsbesicherte Wertpapiere – 0,23 %					1.900	Bunge Limited Finance Corp, 4,590 %, fällig 11.03.2026 **	1.898	0,12
34	Ameriquest Mortgage Securities Inc Asset-Backed Pass-Through Cfts Ser 2004-R5, Series 2004 R5, Class M1, 4,658 %, fällig 25.07.2034 *	34	–	3.425	Charles Schwab Corp/The, 3,810 %, fällig 08.05.2026 **	3.401	0,22	
2.830	Citibank Credit Card Issuance Trust, Series 2017 A6, Class A6, 4,544 %, fällig 14.05.2029 *	2.853	0,18	6.320	Conagra Brands Inc, 11,580 %, fällig 02.03.2026 **	6.318	0,41	
96	JP Morgan Mortgage Acquisition Trust 2006-CH2, Series 2006 CH2, Class AV5, 4,208 %, fällig 25.10.2036 *	96	0,01	4.070	Constellation Energy Generation LLC, 4,760 %, fällig 25.03.2026 **	4.057	0,26	
149	Morgan Stanley Capital I Inc Trust 2006-HE1, Series 2006 HE1, Class A4, 4,368 %, fällig 25.01.2036 *	146	0,01	2.780	Enel Finance America LLC, 5,320 %, fällig 06.03.2026 **	2.778	0,18	
325	RASC Series 2005-KS1 Trust, Series 2005 KS1, Class M2, 4,913 %, fällig 25.02.2035 *	325	0,02	2.569	Enel Finance America LLC, 4,090 %, fällig 31.03.2026 **	2.560	0,17	
91	Structured Asset Securities Corp Mortgage Loan Trust 2005-NC2, Series 2005 NC2, Class M5, 4,718 %, fällig 25.05.2035 *	119	0,01	1.685	Enel Finance America LLC, 3,960 %, fällig 27.04.2026 **	1.674	0,11	
Summe forderungsbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 3.540 \$)				3.573	5.835	Energy Transfer LP, 11,430 %, fällig 02.03.2026 **	5.833	0,38
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 1,25 %					2.540	ERAC USA Finance LLC, 4,810 %, fällig 09.03.2026 **	2.537	0,17
1.158	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM2, Series 2024 NQM2, Class A1, 144A, 6,285 %, fällig 25.02.2064	1.169	0,08	7.845	ERAC USA Finance LLC, 4,570 %, fällig 12.03.2026 **	7.834	0,51	
2.115	BRAVO Residential Funding Trust 2024-NQM5, Series 2024 NQM5, Class A1, 144A, 5,803 %, fällig 25.06.2064	2.137	0,14	4.075	ERAC USA Finance LLC, 4,410 %, fällig 16.03.2026 **	4.068	0,26	
2.355	COLT 2024-1 Mortgage Loan Trust, Series 2024 1, Class A1, 144A, 5,835 %, fällig 25.02.2069	2.369	0,15	2.055	Extra Space Storage Inc, 7,530 %, fällig 03.03.2026 **	2.054	0,13	
306	COLT 2024-3 Mortgage Loan Trust, Series 2024 3, Class A1, 144A, 6,393 %, fällig 25.06.2069	311	0,02	1.580	Extra Space Storage Inc, 4,640 %, fällig 10.03.2026 **	1.578	0,10	
335	Connecticut Avenue Securities Trust 2025-R04, Series 2025 R04, Class 1A1, 144A, 4,667 %, fällig 25.05.2045 *	336	0,02	2.345	Extra Space Storage Inc, 4,320 %, fällig 17.03.2026 **	2.340	0,15	
1.412	Cross 2024-H3 Mortgage Trust, Series 2024 H3, Class A1, 144A, 6,272 %, fällig 25.06.2069	1.430	0,09	3.605	Extra Space Storage Inc, 4,110 %, fällig 31.03.2026 **	3.593	0,23	
3.209	Cross 2024-H5 Mortgage Trust, Series 2024 H5, Class A1, 144A, 5,854 %, fällig 26.08.2069	3.246	0,21	955	General Motors Financial Co Inc, 5,300 %, fällig 06.03.2026 **	954	0,06	
1.174	Freddie Mac Stacr Remic Trust 2025-Dna3, Series 2025 DNA3, Class A1, 144A, 4,617 %, fällig 25.09.2045 *	1.177	0,08	905	General Motors Financial Co Inc, 4,040 %, fällig 05.05.2026 **	898	0,06	
1.533	HOMES 2024-NQM1 Trust, Series 2024 NQM1, Class A1, 144A, 5,915 %, fällig 25.07.2069	1.551	0,10	2.410	General Motors Financial Co Inc, 4,060 %, fällig 03.06.2026 **	2.385	0,16	
846	OBX 2024-NQM3 Trust, Series 2024 NQM3, Class A1, 144A, 6,129 %, fällig 25.12.2063	854	0,05	980	General Motors Financial Co Inc, 4,110 %, fällig 17.07.2026 **	965	0,06	
438	OBX 2024-NQM4 Trust, Series 2024 NQM4, Class A1, 144A, 6,067 %, fällig 25.01.2064	442	0,03	1.725	General Motors Financial Co Inc, 4,100 %, fällig 07.08.2026 **	1.694	0,11	
1.158	OBX 2024-NQM8 Trust, Series 2024 NQM8, Class A1, 144A, 6,233 %, fällig 25.05.2064	1.174	0,08	3.505	Glencore Funding LLC, 5,430 %, fällig 06.03.2026 **	3.502	0,23	
668	Verus Securitization Trust 2023-6, Series 2023 6, Class A1, 144A, 6,665 %, fällig 25.09.2068	673	0,04	3.630	HCA Inc, 12,010 %, fällig 02.03.2026 **	3.629	0,24	
1.027	Verus Securitization Trust 2023-INV2, Series 2023 INV2, Class A1, 144A, 6,443 %, fällig 25.08.2068	1.031	0,07	2.980	Intercontinental Exchange Inc, 5,740 %, fällig 05.03.2026 **	2.978	0,19	
1.225	Verus Securitization Trust 2024-INV1, Series 2024 INV1, Class A1, 144A, 6,116 %, fällig 25.03.2069	1.239	0,08	955	Intercontinental Exchange Inc, 4,440 %, fällig 13.03.2026 **	954	0,06	
186	WaMu Mortgage Pass-Through Certificates Series 2005-AR11 Trust, Series 2005 AR11, Class A1A, 4,428 %, fällig 25.08.2045 *	188	0,01	4.220	Intuit Inc, 7,570 %, fällig 03.03.2026 **	4.218	0,27	
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 19.237 \$)				19.327	1.520	Macquarie Bank Ltd, 4,040 %, fällig 14.05.2026 **	1.521	0,10
Einlagenzertifikate – 0,88 %					1.283	Macquarie Bank Ltd, 4,020 %, fällig 20.05.2026 **	1.284	0,08
1.000	Intesa Sanpaolo S.P.A. (NY), 4,110 %, fällig 19.08.2026	1.000	0,07	1.065	Macquarie Group Ltd, 4,250 %, fällig 19.03.2026 **	1.063	0,07	
4.255	Intesa Sanpaolo S.P.A. (NY), 4,400 %, fällig 19.08.2026	4.262	0,28	1.965	Macquarie Group Ltd, 4,050 %, fällig 06.04.2026 **	1.957	0,12	
2.650	Intesa Sanpaolo S.P.A. (NY), 4,060 %, fällig 09.10.2026	2.650	0,17	3.305	Marriott International Inc, 4,550 %, fällig 13.03.2026 **	3.300	0,21	
5.595	Intesa Sanpaolo S.P.A. (NY), 4,050 %, fällig 14.01.2027	5.598	0,36	3.450	Marriott International Inc, 4,230 %, fällig 24.03.2026 **	3.441	0,22	
Summe Einlagenzertifikate (Anschaffungskosten 13.500 \$)				13.510	1.700	Marriott International Inc, 4,200 %, fällig 25.03.2026 **	1.695	0,11
Commercial Papers – 18,28 %					1.250	Mid-America Apartments LP, 6,320 %, fällig 04.03.2026 **	1.249	0,08
12.825	AES Corp/The, 11,850 %, fällig 02.03.2026 **	12.821	0,83	3.495	Mid-America Apartments LP, 5,320 %, fällig 06.03.2026 **	3.492	0,23	
8.040	Agree Realty Corporation / Agree Limited Partnership, 6,060 %, fällig 05.03.2026 **	8.035	0,52	2.800	Mid-America Apartments LP, 4,510 %, fällig 12.03.2026 **	2.796	0,18	
6.170	Air Lease Corporation, 11,980 %, fällig 02.03.2026 **	6.168	0,40	1.670	Mid-America Apartments LP, 4,280 %, fällig 18.03.2026 **	1.667	0,11	
2.060	Air Lease Corporation, 5,050 %, fällig 09.03.2026 **	2.058	0,13	5.000	NiSource Inc, 4,270 %, fällig 18.03.2026 **	4.990	0,32	
12.740	Alexandria Real Estate Equities Inc, 5,450 %, fällig 06.03.2026 **	12.730	0,83	2.205	ONEOK Inc, 4,760 %, fällig 09.03.2026 **	2.203	0,14	
3.270	Alimentation Couche-Tard Inc, 11,550 %, fällig 02.03.2026 **	3.269	0,21	2.000	ONEOK Inc, 4,220 %, fällig 25.03.2026 **	1.994	0,13	
4.270	Alimentation Couche-Tard Inc, 6,430 %, fällig 04.03.2026 **	4.268	0,28	1.959	O'Reilly Automotive Inc, 4,580 %, fällig 11.03.2026 **	1.956	0,13	
3.955	Alimentation Couche-Tard Inc, 5,420 %, fällig 06.03.2026 **	3.952	0,26	5.840	Penske Truck Leasing Co LP, 4,640 %, fällig 12.03.2026 **	5.832	0,38	
13.490	AutoNation Inc, 12,060 %, fällig 02.03.2026 **	13.485	0,87	2.568	Penske Truck Leasing Co LP, 4,370 %, fällig 20.03.2026 **	2.562	0,17	
4.395	AvalonBay Communities Inc, 5,690 %, fällig 05.03.2026 **	4.392	0,29	1.975	Penske Truck Leasing Co LP, 4,300 %, fällig 24.03.2026 **	1.970	0,13	
3.700	AvalonBay Communities Inc, 4,660 %, fällig 10.03.2026 **	3.696	0,24	2.105	Phillips 66 Co, 4,490 %, fällig 13.03.2026 **	2.102	0,14	
3.510	AvalonBay Communities Inc, 4,510 %, fällig 12.03.2026 **	3.505	0,23	3.835	Phillips 66 Co, 4,160 %, fällig 27.03.2026 **	3.823	0,25	
2.870	B.A.T. International Finance PLC, 7,530 %, fällig 03.03.2026 **	2.869	0,19	4.535	Plains All American Pipeline LP, 5,280 %, fällig 06.03.2026 **	4.532	0,29	
3.135	B.A.T. International Finance PLC, 6,280 %, fällig 04.03.2026 **	3.133	0,20	4.190	Plains All American Pipeline LP, 4,630 %, fällig 10.03.2026 **	4.185	0,27	
5.120	Bayer Corporation, 3,920 %, fällig 20.07.2026 **	5.043	0,33	3.305	Plains All American Pipeline LP, 4,550 %, fällig 11.03.2026 **	3.301	0,21	
4.360	Bayer Corporation, 3,900 %, fällig 09.12.2026 **	4.230	0,27	3.595	Plains All American Pipeline LP, 4,490 %, fällig 12.03.2026 **	3.590	0,23	
2.715	Boston Properties LP, 6,400 %, fällig 04.03.2026 **	2.714	0,18	3.815	Ryder System Inc, 6,280 %, fällig 04.03.2026 **	3.813	0,25	
4.845	Boston Properties LP, 4,370 %, fällig 17.03.2026 **	4.836	0,31	3.405	Ryder System Inc, 5,280 %, fällig 06.03.2026 **	3.402	0,22	
1.305	Boston Properties LP, 4,350 %, fällig 18.03.2026 **	1.302	0,09	2.830	Ryder System Inc, 4,150 %, fällig 25.03.2026 **	2.822	0,18	
				4.000	Sumitomo Mitsui Banking Corporation (SMBC), 4,070 %, fällig 11.12.2026 **	4.000	0,26	
				2.340	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 4,530 %, fällig 09.03.2026 **	2.338	0,15	
				8.245	Targa Resources Corp, 11,550 %, fällig 02.03.2026 **	8.242	0,53	
				1.770	Targa Resources Corp, 5,410 %, fällig 06.03.2026 **	1.769	0,12	
				1.520	Targa Resources Corp, 4,560 %, fällig 12.03.2026 **	1.518	0,10	
				2.670	The Bell Telephone Company of Canada Ltd, 4,130 %, fällig 24.03.2026 **	2.663	0,17	
				7.765	UDR Inc, 6,280 %, fällig 04.03.2026 **	7.761	0,50	
Summe Commercial Papers (Anschaffungskosten 282.105 \$)					282.039		18,28	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 79,91 %					Australien – 3,52 %			
				3.400	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 144A, 4,400 %, fällig 19.05.2026	3.403	0,22	
				4.289	Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 144A, 4,366 %, fällig 16.07.2027 *	4.314	0,28	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			Dänemark – 0,94 %		
Australien – (Fortsetzung)			5.268 Danske Bank A/S, 144A, 5,427 %, fällig 01.03.2028 *	5.347	0,35
3.160 Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 144A, 4,344 %, fällig 30.09.2027 *	3.175	0,20	5.569 Danske Bank A/S, 144A, 4,298 %, fällig 01.04.2028 *	5.590	0,36
3.060 Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 144A, 4,313 %, fällig 18.06.2028 *	3.074	0,20	3.469 Danske Bank A/S, 144A, 4,375 %, fällig 12.06.2028	3.505	0,23
1.170 Australia & New Zealand Banking Group Ltd, 144A, 4,302 %, fällig 08.12.2028 *	1.174	0,08		14.442	0,94
2.533 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 4,156 %, fällig 27.11.2026 *	2.538	0,16	Finnland – 0,23 %		
900 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 4,663 %, fällig 14.03.2027 *	906	0,06	758 Nordea Bank Abp, 144A, 4,437 %, fällig 19.03.2027 *	762	0,05
2.437 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 4,333 %, fällig 14.03.2028 *	2.452	0,16	2.750 Nordea Bank Abp, 144A, 4,397 %, fällig 17.03.2028 *	2.764	0,18
1.445 Glencore Funding LLC, 144A, 4,450 %, fällig 01.10.2026 *	1.448	0,09		3.526	0,23
1.680 Macquarie Bank Ltd, 144A, 5,391 %, fällig 07.12.2026	1.701	0,11	Frankreich – 4,59 %		
5.215 Macquarie Bank Ltd, 144A, 4,172 %, fällig 03.02.2028 *	5.221	0,34	2.680 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 5,896 %, fällig 13.07.2026	2.699	0,18
4.435 Macquarie Bank Ltd, 144A, 4,435 %, fällig 12.06.2028 *	4.461	0,29	390 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 4,835 %, fällig 23.01.2027 *	393	0,03
250 National Australia Bank Ltd, 4,334 %, fällig 12.01.2027 *	251	0,02	770 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 5,088 %, fällig 23.01.2027	778	0,05
2.127 National Australia Bank Ltd, 144A, 4,318 %, fällig 11.06.2027 *	2.137	0,14	4.673 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 4,789 %, fällig 16.02.2028 *	4.716	0,31
1.570 National Australia Bank Ltd, 144A, 4,290 %, fällig 26.10.2027 *	1.575	0,10	3.874 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 4,591 %, fällig 16.10.2028	3.922	0,25
1.500 National Australia Bank Ltd, 144A, 4,212 %, fällig 06.03.2028 *	1.502	0,10	2.486 Banque Federative du Credit Mutuel SA, 144A, 4,691 %, fällig 16.10.2028 *	2.501	0,16
3.195 National Australia Bank Ltd, 144A, 4,343 %, fällig 13.06.2028 *	3.212	0,21	7.506 BNP Paribas SA, 144A, 3,500 %, fällig 16.11.2027	7.454	0,48
3.125 National Australia Bank Ltd, 144A, 4,203 %, fällig 13.12.2028 *	3.128	0,20	765 BNP Paribas SA, 144A, 4,400 %, fällig 14.08.2028	770	0,05
3.155 National Australia Bank Ltd/New York, 3,850 %, fällig 13.12.2028	3.168	0,20	1.648 BNP Paribas SA, 144A, 5,125 %, fällig 13.01.2029 *	1.682	0,11
1.050 Rio Tinto Finance USA Plc, 4,536 %, fällig 14.03.2028 *	1.058	0,07	5.180 BNP Paribas SA, 144A, 5,144 %, fällig 09.05.2029 *	5.236	0,34
4.421 Westpac Banking Corp, 4,147 %, fällig 20.10.2026 *	4.433	0,29	1.420 BPCE SA, 144A, 5,682 %, fällig 19.10.2027 *	1.433	0,09
	54.331	3,52	2.405 BPCE SA, 144A, 6,612 %, fällig 19.10.2027 *	2.444	0,16
Kanada – 7,41 %			7.399 BPCE SA, 144A, 3,500 %, fällig 23.10.2027	7.349	0,48
3.325 Alimentation Couche-Tard Inc, 144A, 4,148 %, fällig 29.09.2028	3.344	0,22	1.880 BPCE SA, 144A, 6,714 %, fällig 19.10.2029 *	1.997	0,13
6.203 Bank of Montreal, 4,582 %, fällig 10.09.2027 *	6.221	0,40	1.595 Credit Agricole SA, 144A, 5,589 %, fällig 05.07.2026	1.604	0,10
2.500 Bank of Montreal, Series J, 4,100 %, fällig 15.12.2027 *	2.503	0,16	250 Credit Agricole SA, 144A, 4,570 %, fällig 11.03.2027 *	251	0,02
6.344 Bank of Montreal, 4,448 %, fällig 22.09.2028 *	6.357	0,41	2.326 Credit Agricole SA, 144A, 5,134 %, fällig 11.03.2027	2.358	0,15
4.763 Bank of Montreal, 4,567 %, fällig 27.01.2029 *	4.776	0,31	7.661 Credit Agricole SA, 144A, 4,631 %, fällig 11.09.2028 *	7.729	0,50
4.498 Bank of Nova Scotia/The, 4,507 %, fällig 04.06.2027 *	4.523	0,29	1.988 Credit Agricole SA, 144A, 4,910 %, fällig 11.09.2028 *	2.002	0,13
4.330 Bank of Nova Scotia/The, 4,713 %, fällig 08.09.2028 *	4.353	0,28	2.666 Credit Agricole SA/London, 144A, 4,125 %, fällig 10.01.2027	2.672	0,17
3.350 Bank of Nova Scotia/The, Series I, 4,456 %, fällig 15.09.2028 *	3.356	0,22	2.140 Societe Generale SA, 144A, 4,000 %, fällig 12.01.2027	2.138	0,14
2.480 Bank of Nova Scotia/The, 4,609 %, fällig 14.02.2029 *	2.492	0,16	2.779 Societe Generale SA, 144A, 4,821 %, fällig 19.02.2027 *	2.791	0,18
3.085 Bank of Nova Scotia/The, 4,441 %, fällig 02.02.2030 *	3.086	0,20	5.835 Societe Generale SA, 144A, 5,250 %, fällig 19.02.2027	5.901	0,38
1.500 Canadian Imperial Bank of Commerce, 4,920 %, fällig 02.10.2026 *	1.508	0,10		70.820	4,59
2.155 Canadian Imperial Bank of Commerce, 5,926 %, fällig 02.10.2026	2.180	0,14	Deutschland – 4,15 %		
3.324 Canadian Imperial Bank of Commerce, 4,642 %, fällig 28.06.2027 *	3.348	0,22	2.910 BMW US Capital LLC, 144A, 4,518 %, fällig 13.08.2026 *	2.918	0,19
2.760 Canadian Imperial Bank of Commerce, 4,508 %, fällig 11.09.2027 *	2.769	0,18	3.315 BMW US Capital LLC, 144A, 4,650 %, fällig 19.03.2027	3.347	0,22
3.870 Canadian Imperial Bank of Commerce, 4,630 %, fällig 11.09.2027 *	3.882	0,25	3.442 BMW US Capital LLC, 144A, 4,638 %, fällig 13.08.2027 *	3.465	0,23
4.780 Canadian Imperial Bank of Commerce, 4,732 %, fällig 30.03.2029 *	4.814	0,31	5.015 BMW US Capital LLC, 144A, 4,618 %, fällig 21.03.2028 *	5.054	0,33
2.105 National Bank of Canada, 4,702 %, fällig 05.03.2027 *	2.105	0,14	2.798 Daimler Truck Finance North America LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.01.2027	2.826	0,18
950 National Bank of Canada, 4,730 %, fällig 02.07.2027 *	952	0,06	1.575 Daimler Truck Finance North America LLC, 144A, 4,300 %, fällig 12.08.2027	1.585	0,10
6.696 National Bank of Canada, 5,600 %, fällig 02.07.2027 *	6.732	0,44	2.582 Daimler Truck Finance North America LLC, 144A, 4,658 %, fällig 25.09.2027 *	2.593	0,17
3.650 National Bank of Canada, 4,166 %, fällig 20.01.2029 *	3.665	0,24	993 Daimler Truck Finance North America LLC, 144A, 4,537 %, fällig 13.01.2028 *	994	0,06
3.150 National Bank of Canada, 4,472 %, fällig 20.01.2029 *	3.155	0,20	1.030 Daimler Truck Finance North America LLC, 144A, 4,150 %, fällig 12.01.2029	1.033	0,07
3.700 Royal Bank of Canada, 4,495 %, fällig 23.07.2027 *	3.707	0,24	6.264 Deutsche Bank AG/New York NY, 7,146 %, fällig 13.07.2027 *	6.335	0,41
5.003 Royal Bank of Canada, 4,422 %, fällig 18.10.2027 *	5.017	0,33	4.230 Deutsche Bank AG/New York NY, 2,552 %, fällig 07.01.2028 *	4.178	0,27
4.006 Royal Bank of Canada, Series 1, 4,412 %, fällig 03.11.2028 *	4.013	0,26	4.415 Deutsche Bank AG/New York NY, 4,906 %, fällig 10.01.2029 *	4.447	0,29
5.119 Royal Bank of Canada, 4,536 %, fällig 24.01.2029 *	5.136	0,33	2.665 Deutsche Bank AG/New York NY, 5,373 %, fällig 10.01.2029 *	2.724	0,18
1.510 Toronto-Dominion Bank/The, 4,781 %, fällig 17.07.2026 *	1.515	0,10	2.494 Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A, 4,800 %, fällig 13.11.2026	2.511	0,16
1.820 Toronto-Dominion Bank/The, 5,532 %, fällig 17.07.2026	1.831	0,12	2.190 Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A, 4,800 %, fällig 11.01.2027	2.208	0,14
847 Toronto-Dominion Bank/The, 4,292 %, fällig 10.09.2026 *	849	0,05	2.165 Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A, 4,480 %, fällig 01.04.2027 *	2.175	0,14
420 Toronto-Dominion Bank/The, 5,264 %, fällig 11.12.2026	425	0,03	2.340 Mercedes-Benz Finance North America LLC, 144A, 4,750 %, fällig 01.08.2027	2.370	0,15
3.620 Toronto-Dominion Bank/The, 4,317 %, fällig 17.12.2026 *	3.629	0,24	1.080 Siemens Funding BV, 144A, 4,364 %, fällig 26.05.2028 *	1.086	0,07
2.645 Toronto-Dominion Bank/The, Series F, 4,277 %, fällig 13.01.2028 *	2.648	0,17	1.875 Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 4,528 %, fällig 20.03.2026 *	1.876	0,12
3.714 Toronto-Dominion Bank/The, 4,530 %, fällig 31.01.2028 *	3.735	0,24	800 Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 4,779 %, fällig 14.08.2026 *	803	0,05
1.735 Toronto-Dominion Bank/The, 5,523 %, fällig 17.07.2028	1.798	0,12	6.420 Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 4,900 %, fällig 14.08.2026	6.442	0,42
3.864 Toronto-Dominion Bank/The, 4,447 %, fällig 13.10.2028 *	3.875	0,25	3.108 Volkswagen Group of America Finance LLC, 144A, 4,450 %, fällig 11.09.2027	3.126	0,20
	114.299	7,41		64.096	4,15

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)		Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)				Spanien – 2,63 %			
Irland – 1,10 %				5.526	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 6,138 %, fällig 14.09.2028 *	5.706	0,37
4.678	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 2,450 %, fällig 29.10.2026	4.633	0,30	2.650	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4,150 %, fällig 03.03.2029	2.651	0,17
4.484	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,875 %, fällig 01.04.2028	4.560	0,29	3.180	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, 4,605 %, fällig 03.03.2029 *	3.183	0,21
5.562	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,000 %, fällig 29.10.2028	5.413	0,35	2.932	Banco Santander SA, 6,527 %, fällig 07.11.2027 *	2.982	0,19
2.425	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,125 %, fällig 28.02.2029	2.427	0,16	2.850	Banco Santander SA, 5,552 %, fällig 14.03.2028 *	2.893	0,19
		17.033	1,10	3.883	Banco Santander SA, 4,816 %, fällig 15.07.2028 *	3.912	0,26
Italien – 0,34 %				6.881	CaixaBank SA, 144A, 6,684 %, fällig 13.09.2027 *	6.979	0,45
685	Enel Finance International NV, 144A, 4,125 %, fällig 30.09.2028	687	0,04	5.325	CaixaBank SA, 144A, 6,208 %, fällig 18.01.2029 *	5.529	0,36
2.405	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,875 %, fällig 14.07.2027	2.402	0,16	6.584	CaixaBank SA, 144A, 4,634 %, fällig 03.07.2029 *	6.665	0,43
895	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 3,875 %, fällig 12.01.2028	892	0,06			40.500	2,63
1.292	UniCredit SpA, 144A, 4,625 %, fällig 12.04.2027	1.301	0,08	Schweden – 1,27 %			
		5.282	0,34	1.837	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A, 4,606 %, fällig 05.03.2027 *	1.851	0,12
Japan – 3,04 %				1.535	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A, 5,125 %, fällig 05.03.2027	1.557	0,10
3.885	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 4,080 %, fällig 19.04.2028 *	3.893	0,25	2.920	Skandinaviska Enskilda Banken AB, 144A, 4,476 %, fällig 02.06.2028 *	2.935	0,19
4.470	Mitsubishi UFJ Financial Group Inc, 5,017 %, fällig 20.07.2028 *	4.537	0,30	2.185	Svenska Handelsbanken AB, 144A, 4,385 %, fällig 28.05.2027 *	2.192	0,14
2.150	Mizuho Markets Cayman LP, 144A, 4,198 %, fällig 01.05.2026 *	2.151	0,14	2.765	Svenska Handelsbanken AB, 144A, 4,462 %, fällig 23.05.2028 *	2.777	0,18
3.695	Mizuho Markets Cayman LP, 144A, 4,220 %, fällig 09.10.2026 *	3.699	0,24	1.450	Svenska Handelsbanken AB, 144A, 5,500 %, fällig 15.06.2028	1.499	0,10
4.195	Mizuho Markets Cayman LP, Series MTn, 144A, 4,221 %, fällig 16.11.2026 *	4.201	0,27	3.306	Swedbank AB, 144A, 6,136 %, fällig 12.09.2026	3.346	0,22
1.445	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 1,402 %, fällig 17.09.2026	1.426	0,09	3.415	Swedbank AB, 144A, 5,337 %, fällig 20.09.2027	3.491	0,22
5.019	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 5,520 %, fällig 13.01.2028	5.175	0,34			19.648	1,27
1.545	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4,108 %, fällig 15.01.2029	1.552	0,10	Schweiz – 1,13 %			
2.055	Sumitomo Mitsui Financial Group Inc, 4,446 %, fällig 15.01.2029 *	2.058	0,13	1.990	UBS AG/Stamford CT, 4,864 %, fällig 10.01.2028 *	2.006	0,13
1.850	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 4,851 %, fällig 14.09.2026 *	1.860	0,12	1.750	UBS Group AG, 144A, 6,327 %, fällig 22.12.2027 *	1.783	0,11
1.030	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 5,650 %, fällig 14.09.2026	1.039	0,07	5.943	UBS Group AG, 144A, 4,282 %, fällig am 01.09.2028	5.959	0,39
1.690	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 5,200 %, fällig 07.03.2027	1.713	0,11	3.918	UBS Group AG, 144A, 6,442 %, fällig 11.08.2028 *	4.049	0,26
3.681	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 4,695 %, fällig 10.09.2027 *	3.713	0,24	3.670	UBS Group AG, 144A, 3,869 %, fällig 12.01.2029 *	3.660	0,24
3.945	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 4,462 %, fällig 11.09.2028 *	3.961	0,26			17.457	1,13
2.670	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 4,407 %, fällig 05.03.2029 *	2.675	0,17	Vereinigtes Königreich – 5,11 %			
3.210	Sumitomo Mitsui Trust Bank Ltd, 144A, 4,200 %, fällig 05.03.2031	3.216	0,21	1.721	BAE Systems Plc, 144A, 5,000 %, fällig 26.03.2027	1.742	0,11
		46.869	3,04	4.065	Barclays Plc, 5,829 %, fällig 09.05.2027 *	4.078	0,26
Niederlande – 3,68 %				4.979	Barclays Plc, 6,496 %, fällig 13.09.2027 *	5.043	0,33
400	ABN AMRO Bank NV, 144A, 5,477 %, fällig 18.09.2027 *	403	0,03	1.788	Barclays Plc, 5,188 %, fällig 12.03.2028 *	1.805	0,12
5.075	ABN AMRO Bank NV, 144A, 6,339 %, fällig 18.09.2027 *	5.139	0,33	3.832	Barclays Plc, 5,501 %, fällig 09.08.2028 *	3.908	0,25
2.515	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,444 %, fällig 07.07.2028 *	2.530	0,16	2.700	BAT Capital Corp, 3,215 %, fällig 06.09.2026	2.691	0,17
3.665	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,727 %, fällig 03.12.2028 *	3.681	0,24	1.835	BAT International Finance Plc, 1,668 %, fällig 25.03.2026	1.832	0,12
4.700	ABN AMRO Bank NV, 144A, 4,988 %, fällig 03.12.2028 *	4.780	0,31	2.112	Lloyds Banking Group Plc, 5,272 %, fällig 07.08.2027 *	2.123	0,14
6.065	AEON Funding Co LLC, 144A, 5,500 %, fällig 16.04.2027	6.152	0,40	2.981	Lloyds Banking Group Plc, 5,985 %, fällig 07.08.2027 *	3.006	0,20
6.739	Coöperatieve Rabobank UA, 3,750 %, fällig 21.07.2026	6.731	0,44	3.337	Lloyds Banking Group Plc, 5,462 %, fällig 05.01.2028 *	3.378	0,22
3.900	Coöperatieve Rabobank UA, 144A, 3,649 %, fällig 06.04.2028 *	3.889	0,25	825	Lloyds Banking Group Plc, 4,781 %, fällig 26.11.2028 *	831	0,05
2.020	Coöperatieve Rabobank UA/NY, 4,345 %, fällig 28.08.2026 *	2.024	0,13	2.491	Lloyds Banking Group Plc, 5,087 %, fällig 26.11.2028 *	2.538	0,17
1.460	Coöperatieve Rabobank UA/NY, 4,314 %, fällig 27.05.2027 *	1.465	0,10	2.485	Lloyds Banking Group Plc, 4,762 %, fällig 13.06.2029 *	2.503	0,16
2.075	Coöperatieve Rabobank UA/NY, 4,108 %, fällig 14.01.2028 *	2.077	0,13	2.635	Lloyds Banking Group Plc, 4,818 %, fällig 13.06.2029 *	2.680	0,17
1.335	Coöperatieve Rabobank UA/NY, 4,883 %, fällig 21.01.2028	1.367	0,09	3.735	Lloyds Banking Group Plc, 4,485 %, fällig 10.02.2030 *	3.728	0,24
1.300	ING Groep NV, 3,950 %, fällig 29.03.2027	1.301	0,08	7.258	Nationwide Building Society, 144A, 6,557 %, fällig 18.10.2027 *	7.374	0,48
846	ING Groep NV, 4,711 %, fällig 01.04.2027 *	846	0,05	4.425	Nationwide Building Society, 144A, 5,009 %, fällig 16.02.2028 *	4.456	0,29
3.371	ING Groep NV, 5,260 %, fällig 11.09.2027 *	3.392	0,22	1.553	Nationwide Building Society, 144A, 4,649 %, fällig 14.07.2029 *	1.572	0,10
2.366	ING Groep NV, 6,083 %, fällig 11.09.2027 *	2.392	0,16	2.645	Nationwide Building Society, 144A, 4,768 %, fällig 14.07.2029 *	2.657	0,17
6.395	ING Groep NV, 4,710 %, fällig 25.03.2029 *	6.440	0,42	3.797	NatWest Group Plc, 5,847 %, fällig 02.03.2027 *	3.797	0,25
2.050	ING Groep NV, 4,858 %, fällig 25.03.2029 *	2.086	0,14	5.174	NatWest Group Plc, 4,974 %, fällig 01.03.2028 *	5.207	0,34
		56.695	3,68	2.506	NatWest Group Plc, 5,583 %, fällig 01.03.2028 *	2.546	0,17
Neuseeland – 0,20 %				1.595	NatWest Group Plc, 4,822 %, fällig 23.05.2029 *	1.606	0,10
3.120	ANZ New Zealand Int'l Ltd/London, 144A, 4,298 %, fällig 22.01.2029 *	3.120	0,20	1.800	Santander UK Group Holdings Plc, 3,823 %, fällig 03.11.2028 *	1.793	0,12
				5.620	Santander UK Group Holdings Plc, 6,534 %, fällig 10.01.2029 *	5.865	0,38
						78.759	5,11
				USA – 40,57 %			
				3.710	AbbVie Inc, 3,775 %, fällig 03.03.2028	3.715	0,24
				1.590	AbbVie Inc, 4,207 %, fällig 03.03.2028 *	1.594	0,10
				3.870	Air Lease Corp, 5,300 %, fällig 25.06.2026	3.884	0,25
				2.945	Ameren Corp, 5,700 %, fällig 01.12.2026	2.978	0,19
				1.508	American Express Co, 4,678 %, fällig 28.07.2027 *	1.512	0,10
				3.257	American Express Co, 4,719 %, fällig 16.02.2028 *	3.275	0,21
				2.192	American Express Co, 4,637 %, fällig 26.07.2028 *	2.202	0,14
				2.160	American Express Co, 4,009 %, fällig 09.02.2029 *	2.167	0,14
				2.160	American Express Co, 4,305 %, fällig 09.02.2029 *	2.161	0,14
				3.050	American Express Co, 4,967 %, fällig 25.04.2029 *	3.088	0,20
				4.802	American Express Co, 4,351 %, fällig 20.07.2029 *	4.848	0,31
				2.580	American Honda Finance Corp, Series A, 4,373 %, fällig 20.05.2026 *	2.583	0,17
				2.580	American Honda Finance Corp, 4,322 %, fällig 11.12.2026 *	2.587	0,17

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
2.630 American Honda Finance Corp, 4,448 %, fällig 13.08.2027 *	2.642	0,17	1.445 Dominion Energy Inc, 4,600 %, fällig 15.05.2028	1.466	0,10
2.734 American Honda Finance Corp, 4,425 %, fällig 22.10.2027 *	2.746	0,18	4.735 DTE Energy Co, 4,950 %, fällig 01.07.2027	4.793	0,31
4.070 American Honda Finance Corp, 4,547 %, fällig 03.03.2028 *	4.089	0,27	1.205 DTE Energy Co, 4,875 %, fällig 01.06.2028	1.229	0,08
2.375 American Tower Corp, 1,600 %, fällig 15.04.2026	2.368	0,15	2.782 Duke Energy Corp, 4,850 %, fällig 05.01.2027	2.805	0,18
1.078 American Tower Corp, 3,375 %, fällig 15.10.2026	1.074	0,07	1.755 Eli Lilly & Co, 4,000 %, fällig 15.10.2028	1.772	0,12
1.000 American Tower Corp, 2,750 %, fällig 15.01.2027	990	0,06	4.370 Eli Lilly & Co, 4,230 %, fällig 15.10.2028 *	4.398	0,29
2.066 American Tower Corp, 3,650 %, fällig 15.03.2027	2.060	0,13	1.701 Energy Transfer LP, 3,900 %, fällig 15.07.2026	1.699	0,11
2.015 Amphenol Corp, 3,800 %, fällig 15.11.2027	2.019	0,13	1.237 Enterprise Products Operating LLC, 4,300 %, fällig 20.06.2028	1.251	0,08
690 Amphenol Corp, 4,249 %, fällig 15.11.2027 *	691	0,05	1.449 Essex Portfolio LP, 3,375 %, fällig 15.04.2026	1.447	0,09
3.530 Amphenol Corp, 4,375 %, fällig 12.06.2028	3.577	0,23	4.911 Eversource Energy, 4,750 %, fällig 15.05.2026	4.918	0,32
2.929 Arthur J Gallagher & Co, 4,600 %, fällig 15.12.2027	2.963	0,19	1.638 Fifth Third Bancorp, 6,361 %, fällig 27.10.2028 *	1.701	0,11
2.850 AT&T Inc, 3,800 %, fällig 15.02.2027	2.849	0,19	2.895 Fifth Third Bank NA, 4,518 %, fällig 28.01.2028 *	2.899	0,19
4.520 AT&T Inc, 4,250 %, fällig 01.03.2027	4.532	0,29	2.890 Fifth Third Bank NA, 4,967 %, fällig 28.01.2028 *	2.915	0,19
2.996 AT&T Inc, 2,300 %, fällig 01.06.2027	2.940	0,19	3.790 GA Global Funding Trust, 144A, 4,400 %, fällig 23.09.2027	3.804	0,25
3.299 Athene Global Funding, 144A, 4,860 %, fällig 27.08.2026	3.311	0,22	695 GE HealthCare Technologies Inc, 4,150 %, fällig 15.12.2028	699	0,05
4.328 Athene Global Funding, 144A, 4,950 %, fällig 07.01.2027	4.360	0,28	2.371 General Motors Financial Co Inc, 5,400 %, fällig 06.04.2026	2.374	0,15
3.321 Athene Global Funding, 144A, 5,349 %, fällig 09.07.2027	3.372	0,22	977 General Motors Financial Co Inc, 1,500 %, fällig 10.06.2026	970	0,06
5.149 Athene Global Funding, 144A, 4,663 %, fällig 06.03.2028 *	5.152	0,33	280 General Motors Financial Co Inc, 5,064 %, fällig 08.05.2027 *	282	0,02
2.500 Athene Global Funding, 144A, 4,697 %, fällig 18.09.2028 *	2.494	0,16	2.607 General Motors Financial Co Inc, 4,750 %, fällig 15.07.2027 *	2.614	0,17
1.005 Bank of America Corp, 4,250 %, fällig 22.10.2026	1.007	0,07	1.050 Georgia Power Co, 3,976 %, fällig 15.09.2026 *	1.050	0,07
1.505 Bank of America Corp, 5,933 %, fällig 15.09.2027 *	1.521	0,10	783 Georgia-Pacific LLC, 144A, 0,950 %, fällig 15.05.2026	778	0,05
1.657 Bank of America Corp, 4,762 %, fällig 04.02.2028 *	1.666	0,11	640 Georgia-Pacific LLC, 144A, 4,400 %, fällig 30.06.2028	648	0,04
6.973 Bank of America Corp, Series frn, 4,538 %, fällig 24.01.2029 *	7.002	0,45	3.825 Goldman Sachs Bank USA/New York NY, 4,472 %, fällig 21.05.2027 *	3.829	0,25
1.257 Bank of America Corp, 4,623 %, fällig 09.05.2029 *	1.275	0,08	4.581 Goldman Sachs Bank USA/New York NY, 5,414 %, fällig 21.05.2027 *	4.595	0,30
2.980 Bank of America Corp, 4,827 %, fällig 09.05.2029 *	3.006	0,20	850 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,522 %, fällig 10.09.2027 *	852	0,06
624 Bank of America NA, 5,526 %, fällig 18.08.2026	628	0,04	57 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,683 %, fällig 28.10.2027 *	58	–
2.375 Bank of New York Mellon Corp/The, 4,390 %, fällig 09.06.2028 *	2.383	0,15	3.102 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,995 %, fällig 23.04.2028 *	3.126	0,20
1.095 Bank of New York Mellon Corp/The, 4,441 %, fällig 09.06.2028 *	1.103	0,07	1.600 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,148 %, fällig 21.01.2029 *	1.601	0,10
1.716 Bank of New York Mellon Corp/The, 4,532 %, fällig 21.07.2028 *	1.725	0,11	3.200 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,412 %, fällig 21.01.2029 *	3.202	0,21
6.845 Bank of New York Mellon Corp/The, 4,335 %, fällig 22.01.2030 *	6.847	0,44	3.500 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,622 %, fällig 21.10.2029 *	3.512	0,23
1.570 Bank of New York Mellon/The, 4,587 %, fällig 20.04.2027 *	1.571	0,10	2.132 Haleon US Capital LLC, 3,375 %, fällig 24.03.2027	2.122	0,14
3.687 Boeing Co/The, 3,100 %, fällig 01.05.2026	3.681	0,24	900 Home Depot Inc/The, 3,750 %, fällig 15.09.2028	904	0,06
1.790 Boeing Co/The, 2,250 %, fällig 15.06.2026	1.780	0,12	830 Huntington Bancshares Inc/OH, 4,443 %, fällig 04.08.2028 *	836	0,05
4.560 Boeing Co/The, 2,700 %, fällig 01.02.2027	4.512	0,29	5.420 Huntington National Bank/The, 4,417 %, fällig 12.04.2028 *	5.428	0,35
2.561 Boeing Co/The, 5,040 %, fällig 01.05.2027	2.589	0,17	2.248 Huntington National Bank/The, 4,871 %, fällig 12.04.2028 *	2.267	0,15
4.035 Boston Properties LP, 2,750 %, fällig 01.10.2026	4.004	0,26	5.456 Hyatt Hotels Corp, 5,750 %, fällig 30.01.2027	5.531	0,36
1.104 Broadcom Inc, 5,050 %, fällig 12.07.2027	1.123	0,07	1.275 Hyundai Capital America, 144A, 1,650 %, fällig 17.09.2026	1.259	0,08
1.008 Broadcom Inc, 4,800 %, fällig 15.04.2028	1.029	0,07	2.845 Hyundai Capital America, 144A, 4,737 %, fällig 19.03.2027 *	2.860	0,19
3.060 Brown & Brown Inc, 4,600 %, fällig 23.12.2026	3.076	0,20	5.346 Hyundai Capital America, 144A, 5,300 %, fällig 19.03.2027	5.421	0,35
4.618 Camden Property Trust, 5,850 %, fällig 03.11.2026	4.671	0,30	1.100 Hyundai Capital America, 144A, 4,850 %, fällig 25.03.2027	1.111	0,07
2.135 Capital One Financial Corp, 4,100 %, fällig 09.02.2027	2.138	0,14	3.761 Hyundai Capital America, 144A, 4,739 %, fällig 24.06.2027 *	3.786	0,25
2.627 Capital One Financial Corp, 3,750 %, fällig 09.03.2027	2.624	0,17	2.757 Hyundai Capital America, 144A, 4,729 %, fällig 24.09.2027 *	2.772	0,18
5.300 Capital One Financial Corp, 7,149 %, fällig 29.10.2027 *	5.406	0,35	1.867 Illumina Inc, 4,650 %, fällig 09.09.2026	1.874	0,12
5.394 Capital One Financial Corp, 4,927 %, fällig 10.05.2028 *	5.448	0,35	1.310 Intercontinental Exchange Inc, 3,950 %, fällig 01.12.2028	1.312	0,09
2.933 Capital One Financial Corp, 6,312 %, fällig 08.06.2029 *	3.070	0,20	4.965 Jefferies Financial Group Inc, 4,500 %, fällig 15.09.2026	4.966	0,32
2.990 Cargill Inc, 144A, 4,326 %, fällig 11.02.2028 *	3.002	0,20	4.195 John Deere Capital Corp, Series mtN, 4,313 %, fällig 11.06.2027 *	4.215	0,27
1.052 Caterpillar Financial Services Corp, 4,391 %, fällig 16.10.2026 *	1.055	0,07	4.537 John Deere Capital Corp, 4,224 %, fällig 06.03.2028 *	4.559	0,30
4.267 Caterpillar Financial Services Corp, 4,279 %, fällig 15.11.2027 *	4.284	0,28	2.600 John Deere Capital Corp, 4,293 %, fällig 11.09.2028 *	2.610	0,17
3.960 Caterpillar Financial Services Corp, 4,299 %, fällig 14.11.2028 *	3.980	0,26	2.182 JPMorgan Chase & Co, 4,625 %, fällig 22.04.2028 *	2.194	0,14
4.060 Caterpillar Financial Services Corp, 4,212 %, fällig 23.02.2029 *	4.075	0,26	4.968 JPMorgan Chase & Co, 5,571 %, fällig 22.04.2028 *	5.058	0,33
815 Charles Schwab Corp/The, 4,238 %, fällig 13.05.2026 *	815	0,05	3.035 JPMorgan Chase & Co, 4,505 %, fällig 22.10.2028 *	3.062	0,20
2.770 Charles Schwab Corp/The, 4,777 %, fällig 03.03.2027 *	2.792	0,18	3.680 JPMorgan Chase & Co, 4,565 %, fällig 22.10.2028 *	3.696	0,24
1.915 Chevron USA Inc, 4,194 %, fällig 26.02.2028 *	1.928	0,13	4.628 JPMorgan Chase & Co, 4,506 %, fällig 24.01.2029 *	4.651	0,30
2.150 Chevron USA Inc, 4,288 %, fällig 13.08.2028 *	2.166	0,14	1.184 Kroger Co/The, 2,650 %, fällig 15.10.2026	1.176	0,08
3.684 Citibank NA, 4,876 %, fällig 19.11.2027 *	3.710	0,24	6.169 Lennar Corp, 5,250 %, fällig 01.06.2026	6.174	0,40
2.854 Citigroup Inc, 4,481 %, fällig 09.06.2027 *	2.857	0,19	2.669 Lowe's Cos Inc, 3,950 %, fällig 15.10.2027	2.678	0,17
4.190 Citigroup Inc, 4,859 %, fällig 07.05.2028 *	4.215	0,27	3.390 Lowe's Cos Inc, 4,000 %, fällig 15.10.2028	3.401	0,22
6.822 Citigroup Inc, 4,597 %, fällig 04.03.2029 *	6.834	0,44	1.455 Marriott International Inc/MD, Series R, 3,125 %, fällig 15.06.2026	1.452	0,09
5.390 CNO Global Funding, 144A, 1,750 %, fällig 07.10.2026	5.317	0,35	210 Marriott International Inc/MD, 5,450 %, fällig 15.09.2026	211	0,01
1.190 CNO Global Funding, 144A, 4,875 %, fällig 10.12.2027	1.202	0,08	3.312 Marriott International Inc/MD, 4,200 %, fällig 15.07.2027	3.327	0,22
1.470 Constellation Energy Generation LLC, 3,900 %, fällig 08.01.2028	1.471	0,10	1.476 Marriott International Inc/MD, Series X, 4,000 %, fällig 15.04.2028	1.481	0,10
1.540 Constellation Energy Generation LLC, 4,295 %, fällig 08.01.2028 *	1.543	0,10	3.508 Mars Inc, 144A, 4,450 %, fällig 01.03.2027	3.537	0,23
3.447 Corebridge Global Funding, 144A, 5,350 %, fällig 24.06.2026	3.462	0,22			
4.043 Corebridge Global Funding, 144A, 5,000 %, fällig 25.09.2026 *	4.063	0,26			
3.292 CVS Health Corp, 2,875 %, fällig 01.06.2026	3.284	0,21			
4.711 CVS Health Corp, 3,000 %, fällig 15.08.2026	4.691	0,30			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – (Fortsetzung)			4.445 Public Storage Operating Co, 4,401 %, fällig 16.04.2027 *	4.464	0,29	
USA – (Fortsetzung)			2.528 Realty Income Corp, 0,750 %, fällig 15.03.2026	2.525	0,16	
2.042 Marsh & McLennan Cos Inc, 4,414 %, fällig 08.11.2027 *	2.050	0,13	4.353 Realty Income Corp, 4,875 %, fällig 01.06.2026	4.354	0,28	
2.315 MassMutual Global Funding II, 144A, 4,435 %, fällig 09.04.2027 *	2.324	0,15	2.854 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 4,250 %, fällig 01.07.2026	2.853	0,19	
1.500 McCormick & Co Inc/MD, 4,150 %, fällig 15.02.2029	1.510	0,10	2.533 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 31.08.2026	2.533	0,16	
2.890 Merck & Co Inc, 4,292 %, fällig 15.03.2029 *	2.899	0,19	1.203 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,375 %, fällig 15.07.2027	1.212	0,08	
531 Met Tower Global Funding, 144A, 4,000 %, fällig 01.10.2027	533	0,04	565 Southern Co Gas Capital Corp, Series A, 4,050 %, fällig 15.09.2028	567	0,04	
2.575 Met Tower Global Funding, 144A, 4,000 %, fällig 14.01.2029	2.580	0,17	946 State Street Bank & Trust Co, 4,183 %, fällig 25.11.2026 *	948	0,06	
542 Meta Platforms Inc, 3,500 %, fällig 15.08.2027	542	0,04	680 State Street Corp, 4,558 %, fällig 03.08.2026 *	681	0,04	
1.408 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 4,400 %, fällig 11.06.2027 *	1.413	0,09	1.183 State Street Corp, 4,345 %, fällig 22.10.2027 *	1.188	0,08	
500 Metropolitan Life Global Funding I, 4,400 %, fällig 11.06.2027 *	502	0,03	1.090 State Street Corp, 4,656 %, fällig 24.04.2028 *	1.096	0,07	
3.735 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 4,150 %, fällig 25.08.2028	3.765	0,24	490 Synopsys Inc, 4,550 %, fällig 01.04.2027	494	0,03	
5.155 Metropolitan Life Global Funding I, 144A, 4,423 %, fällig 25.08.2028 *	5.174	0,34	1.542 Target Corp, 4,350 %, fällig 15.06.2028	1.564	0,10	
4.310 Mondelez International Inc, 4,250 %, fällig 06.05.2028	4.344	0,28	2.756 T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	2.751	0,18	
785 Mondelez International Inc, 4,125 %, fällig 07.05.2028	788	0,05	1.652 Toyota Motor Credit Corp, 4,146 %, fällig 10.04.2026 *	1.653	0,11	
320 Morgan Stanley, 3,125 %, fällig 27.07.2026	319	0,02	1.490 Toyota Motor Credit Corp, 4,484 %, fällig 07.08.2026 *	1.494	0,10	
3.410 Morgan Stanley, 4,720 %, fällig 13.04.2028 *	3.427	0,22	3.850 Toyota Motor Credit Corp, 4,150 %, fällig 18.11.2027 *	3.865	0,25	
3.513 Morgan Stanley, 5,080 %, fällig 12.04.2029 *	3.563	0,23	2.065 Toyota Motor Credit Corp, Series B, 4,147 %, fällig 12.01.2028 *	2.070	0,13	
4.540 Morgan Stanley, Series I, 4,625 %, fällig 18.10.2029 *	4.565	0,30	5.288 Toyota Motor Credit Corp, 4,436 %, fällig 05.09.2028 *	5.332	0,35	
4.900 Morgan Stanley Bank NA, 4,641 %, fällig 14.07.2028 *	4.927	0,32	5.415 Truist Bank, 4,671 %, fällig 20.05.2027 *	5.423	0,35	
1.287 Morgan Stanley Bank NA, 4,597 %, fällig 12.01.2029 *	1.294	0,08	3.677 Truist Bank, 4,420 %, fällig 24.07.2028 *	3.701	0,24	
1.650 Mutual of Omaha Cos Global Funding, 144A, 5,800 %, fällig 27.07.2026	1.662	0,11	3.870 Truist Bank, 4,476 %, fällig 24.07.2028 *	3.879	0,25	
270 Netflix Inc, 4,375 %, fällig 15.11.2026	271	0,02	3.422 Truist Financial Corp, 6,047 %, fällig 08.06.2027 *	3.439	0,22	
1.200 Netflix Inc, 5,875 %, fällig 15.11.2028	1.263	0,08	1.567 UnitedHealth Group Inc, 4,200 %, fällig 15.07.2026 *	1.569	0,10	
3.924 New York Life Global Funding, 144A, 4,370 %, fällig 02.04.2027 *	3.942	0,26	2.630 US Bank NA/Cincinnati OH, 4,395 %, fällig 22.10.2027 *	2.634	0,17	
3.415 New York Life Global Funding, 144A, 4,587 %, fällig 25.04.2028 *	3.443	0,22	5.241 US Bank NA/Cincinnati OH, 4,507 %, fällig 22.10.2027 *	5.263	0,34	
3.364 New York Life Global Funding, 144A, 4,367 %, fällig 25.07.2028 *	3.377	0,22	1.885 US Bank NA/Cincinnati OH, 4,629 %, fällig 15.05.2028 *	1.895	0,12	
1.375 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 3,550 %, fällig 01.05.2027	1.370	0,09	3.845 US Bank NA/Cincinnati OH, 4,730 %, fällig 15.05.2028 *	3.884	0,25	
590 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 4,685 %, fällig 01.09.2027	597	0,04	3.257 Veralto Corp, 5,500 %, fällig 18.09.2026	3.280	0,21	
2.101 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 4,512 %, fällig 04.02.2028 *	2.115	0,14	1.125 WEC Energy Group Inc, 5,600 %, fällig 12.09.2026	1.133	0,07	
490 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 4,850 %, fällig 04.02.2028	499	0,03	1.050 Wells Fargo & Co, 3,196 %, fällig 17.06.2027 *	1.047	0,07	
1.114 Northwestern Mutual Global Funding, 144A, 5,070 %, fällig 25.03.2027	1.129	0,07	4.420 Wells Fargo & Co, 4,486 %, fällig 24.01.2028 *	4.433	0,29	
3.750 Northwestern Mutual Global Funding, 144A, 4,383 %, fällig 25.08.2028 *	3.757	0,24	2.493 Wells Fargo & Co, 4,775 %, fällig 22.04.2028 *	2.509	0,16	
2.475 Novartis Capital Corp, 4,232 %, fällig 05.11.2028 *	2.494	0,16	4.316 Wells Fargo & Co, 5,707 %, fällig 22.04.2028 *	4.396	0,29	
3.558 ONEOK Inc, 5,550 %, fällig 01.11.2026	3.590	0,23	6.781 Wells Fargo & Co, 5,075 %, fällig 23.04.2029 *	6.898	0,45	
149 ONEOK Inc, 5,650 %, fällig 01.11.2028	155	0,01	1.195 Wisconsin Electric Power Co, 3,950 %, fällig 01.03.2029	1.199	0,08	
2.623 Oracle Corp, 1,650 %, fällig 25.03.2026	2.618	0,17		625.778	40,57	
3.085 Oracle Corp, 4,472 %, fällig 03.08.2028 *	3.053	0,20	Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.228.381 \$)		1.232.655	79,91
3.573 Owens Corning, 3,400 %, fällig 15.08.2026	3.562	0,23	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,14 %			
1.774 Owens Corning, 5,500 %, fällig 15.06.2027	1.807	0,12	USA – 0,14 %			
734 Pacific Life Global Funding II, 144A, 4,758 %, fällig 28.07.2026 *	736	0,05	2.113 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 30.04.2026	2.117	0,14	
1.392 Pacific Life Global Funding II, 144A, 4,562 %, fällig 05.02.2027 *	1.399	0,09	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 2.116 \$)		2.117	0,14
1.755 PayPal Holdings Inc, 4,383 %, fällig 06.03.2028 *	1.760	0,11	Organismen für gemeinsame Anlagen – 0,00 %			
1.430 Pfizer Inc, 4,219 %, fällig 15.11.2027 *	1.435	0,09	24 JPMorgan Liquidity Funds — USD Liquidity LVNAV Fund	24	–	
1.865 Philip Morris International Inc, 4,375 %, fällig 01.11.2027	1.884	0,12	Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 24 \$)		24	–
5.751 Philip Morris International Inc, 4,540 %, fällig 28.04.2028 *	5.786	0,38	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 1.548.903 \$)		1.553.245	100,69
3.580 Philip Morris International Inc, 4,367 %, fällig 27.10.2028 *	3.587	0,23	Devisenterminkontrakte – 0,00 %			
1.220 Phillips 66 Co, 3,550 %, fällig 01.10.2026	1.217	0,08	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		1	–
1.145 PNC Bank NA, 4,429 %, fällig 21.07.2028 *	1.153	0,08	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		1.553.246	100,69
1.125 PNC Bank NA, 4,432 %, fällig 21.07.2028 *	1.127	0,07	Devisenterminkontrakte: 0,00 %			
4.274 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,102 %, fällig 23.07.2027 *	4.293	0,28	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		-1	–
3.630 PNC Financial Services Group Inc/The, 4,075 %, fällig 26.01.2029 *	3.642	0,24	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		-1	–
3.110 PNC Financial Services Group Inc/The, 4,327 %, fällig 26.01.2029 *	3.110	0,20	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		1.553.245	100,69
495 Principal Life Global Funding II, 144A, 4,600 %, fällig 19.08.2027	500	0,03	Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten		-10.689	-0,69
4.190 Principal Life Global Funding II, 144A, 4,530 %, fällig 18.08.2028 *	4.194	0,27	Gesamtvermögen		1.542.556 \$	100,00
1.574 Protective Life Global Funding, 144A, 4,396 %, fällig 10.04.2026 *	1.575	0,10				
1.230 Protective Life Global Funding, 144A, 4,992 %, fällig 12.01.2027	1.242	0,08				
2.490 Protective Life Global Funding, 144A, 4,335 %, fällig 13.09.2027	2.511	0,16				
3.500 Protective Life Global Funding, 144A, 4,161 %, fällig 15.01.2029	3.506	0,23				

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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 2026 beliefen sich diese Wertpapiere auf 455.452.000 \$ und machten 29,51 % des Nettovermögens aus.
- * Wertpapier mit variablem Zinssatz. Der aufgeführte Zinssatz entspricht dem Zinssatz vom 28. Februar 2026.
- ** Zinssatz spiegelt die Endfälligkeitsrendite zum 28. Februar 2026 wider.

ABKÜRZUNGEN:

REMIC – Real Estate Mortgage Investment Conduit

	% des Gesamtvermögens
Verteilung des Gesamtvermögens	
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	80,32
Organismen für gemeinsame Anlagen	–
Finanzderivate	–
Geldmarktinstrumente	18,87
Sonstige Vermögenswerte	0,81
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)		Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	1	Verkauf	SGD	2 \$ –
13. März 2026	BNY	Kauf	USD	4	Verkauf	SGD	5 –
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	940	Verkauf	USD	745 -1
13. März 2026	BNY	Kauf	GBP	9	Verkauf	USD	12 –
13. März 2026	BNY	Kauf	EUR	4	Verkauf	USD	4 –
13. März 2026	BNY	Kauf	SGD	653	Verkauf	USD	516 1
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten						\$	1
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten							-1
Nettowertsteigerung aus Devisenterminkontrakten						\$	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 95,40 %			Luxemburg – 0,33 %		
Australien – 0,10 %			EUR 100 INEOS Finance Plc, 6,375 %, fällig 15.04.2029		
30 Mineral Resources Ltd, 144A, 7,000 %, fällig 01.04.2031	32	0,10	Mexiko – 0,52 %		
Österreich – 1,18 %			200 Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047		
EUR 200 Benteler International AG, 7,250 %, fällig 15.06.2031	253	0,79	Niederlande – 1,44 %		
EUR 100 Raiffeisen Bank International AG, 7,375 %, fällig 20.12.2032 *	125	0,39	EUR 100 Boels Topholding BV, 5,750 %, fällig 15.05.2030		
	378	1,18	EUR 100 Sunrise FinCo I BV, 4,625 %, fällig 15.05.2032		
Kanada – 0,97 %			EUR 100 VZ Secured Financing BV, 5,250 %, fällig 15.01.2033		
95 1011778 BC ULC / New Red Finance Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.10.2030	92	0,28	EUR 100 Ziggo Bond Co BV, 3,375 %, fällig 28.02.2030		
65 Bombardier Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.11.2030	70	0,22			
5 Bombardier Inc, 144A, 7,000 %, fällig 01.06.2032	5	0,02	Polen – 0,38 %		
40 Bombardier Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.06.2033	42	0,13	EUR 100 mBank SA, 8,375 %, fällig 11.09.2027 *		
70 Great Canadian Gaming Corp/Raptor LLC, 144A, 8,750 %, fällig 15.11.2029	71	0,22	Spanien – 1,10 %		
30 Jones Deslauriers Insurance Management Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.03.2030	31	0,10	EUR 200 Grifols SA, 3,875 %, fällig 15.10.2028		
	311	0,97	EUR 100 Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA, 4,875 %, fällig 15.04.2031		
Kolumbien – 0,28 %					
100 Ecopetrol SA, 4,625 %, fällig 02.11.2031	90	0,28	Schweden – 0,73 %		
Tschechische Republik: 1,69 %			EUR 200 Verisure Midholding AB, 5,250 %, fällig 15.02.2029		
EUR 300 CPI Property Group SA, 1,500 %, fällig 27.01.2031	298	0,93	Schweiz – 0,38 %		
EUR 100 Energo – Pro as, 8,000 %, fällig 27.05.2030	126	0,39	EUR 100 Dufry One BV, 4,750 %, fällig 18.04.2031		
EUR 100 Energo – Pro as, 6,450 %, fällig 15.04.2031	119	0,37	Vereinigtes Königreich – 5,19 %		
	543	1,69	GBP 100 Bellis Acquisition Co Plc, 8,125 %, fällig 14.05.2030		
Dänemark – 0,65 %			EUR 100 Boots Group Finco LP, 5,375 %, fällig 31.08.2032		
200 GENMAB A/S/GENMAB FINANCE LLC, 144A, 6,250 %, fällig 15.12.2032	208	0,65	EUR 100 California Buyer Ltd / Atlantica Sustainable Infrastructure Plc, 5,625 %, fällig 15.02.2032		
Estland – 0,39 %			200 Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029		
EUR 100 Eesti Energia AS, 7,875 %, ewige Anleihe *	124	0,39	GBP 100 Deuce Finco Plc, 7,000 %, fällig 20.11.2031		
Frankreich – 4,81 %			200 Froneri Lux FinCo SARL, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2032		
EUR 200 Electricite de France SA, 3,375 %, ewige Anleihe *	229	0,72	GBP 200 Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030		
EUR 200 Forvia SE, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2033	206	0,64	GBP 100 Pinewood Finco Plc, 6,000 %, fällig 27.03.2030		
EUR 100 Getlink SE, 4,125 %, fällig 15.04.2030	121	0,38	GBP 170 Virgin Media Secured Finance Plc, 5,250 %, fällig 15.05.2029		
EUR 100 Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement SAS, 3,875 %, fällig 31.01.2031	118	0,37	EUR 90 Zegona Finance Plc, 6,750 %, fällig 15.07.2029		
EUR 150 Iliad Holding SAS, 5,375 %, fällig 15.04.2030	184	0,57			
EUR 100 IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 15.06.2031	113	0,35	USA – 62,78 %		
EUR 100 Kapla Holding SAS, 5,000 %, fällig 30.04.2031	121	0,38	70 Acrisure LLC / Acrisure Finance Inc, 144A, 7,500 %, fällig 06.11.2030		
EUR 100 New Immo Holding SA, 5,875 %, fällig 17.04.2028	123	0,38	95 Adient Global Holdings Ltd, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2031		
200 Opal Bidco SAS, 144A, 6,500 %, fällig 31.03.2032	206	0,64	85 Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 144A, 5,875 %, fällig 01.11.2029		
EUR 100 SNF Group SACA, 4,500 %, fällig 15.03.2032	123	0,38	85 Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 144A, 7,000 %, fällig 15.01.2031		
	1.544	4,81	20 Alliant Holdings Intermediate LLC / Alliant Holdings Co-Issuer, 144A, 7,375 %, fällig 01.10.2032		
Deutschland – 2,46 %			45 American Airlines Inc/AAdvantage Loyalty IP Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 20.04.2029		
EUR 100 Cidron Atrium SE, 5,625 %, fällig 15.02.2033	118	0,37	50 American Axle & Manufacturing Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.10.2032		
EUR 220 CTEC II GmbH, 5,250 %, fällig 15.02.2030	248	0,77	190 APLD ComputeCo LLC, 144A, 9,250 %, fällig 15.12.2030		
EUR 250 Dynamo Newco II GmbH, 6,250 %, fällig 15.10.2031	300	0,93	145 Apollo Commercial Real Estate Finance Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.06.2029		
EUR 100 IHO Verwaltungs GmbH, 6,750 %, fällig 15.11.2029	125	0,39	EUR 100 Aramark International Finance Sarl, 4,375 %, fällig 15.04.2033		
	791	2,46	40 Archrock Services LP / Archrock Partners Finance Corp, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2034		
Griechenland – 0,40 %			85 Arcosa Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.08.2032		
EUR 100 Piraeus Bank SA, 7,250 %, fällig 17.04.2034 *	130	0,40	165 Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 2,000 %, fällig 01.09.2028		
Irland: 0,84 %			140 Ashton Woods USA LLC / Ashton Woods Finance Co, 144A, 6,875 %, fällig 01.08.2033		
GBP 200 Flutter Treasury DAC, 6,125 %, fällig 04.06.2031	271	0,84	100 Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032		
Israel – 0,78 %			140 Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2034		
EUR 205 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,375 %, fällig 09.05.2030	251	0,78	110 AthenaHealth Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.02.2030		
Italien – 6,61 %			25 ATI Inc, 5,125 %, fällig 01.10.2031		
EUR 100 Banca Monte dei Paschi di Siena SpA, 6,750 %, fällig 05.09.2027 *	121	0,38	25 Avient Corp, 144A, 6,250 %, fällig 01.11.2031		
EUR 100 Bubbles Bidco SPA, 6,500 %, fällig 30.09.2031	122	0,38	45 Axon Enterprise Inc, 144A, 6,125 %, fällig 15.03.2030		
EUR 200 FIS Fabbrica Italiana Sintetici SpA, 5,279 %, fällig 05.02.2031 *	237	0,74	65 Axon Enterprise Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2033		
EUR 350 Gruppo San Donato SPA, 6,500 %, fällig 31.10.2031	422	1,31	100 Ball Corp, 4,250 %, fällig 01.07.2032		
EUR 115 Intesa Sanpaolo SpA, 2,925 %, fällig 14.10.2030	135	0,42	80 Bath & Body Works Inc, 6,875 %, fällig 01.11.2035		
200 Kedrion SpA, 144A, 6,500 %, fällig 01.09.2029	195	0,61	35 Bausch + Lomb Corp, 144A, 8,375 %, fällig 01.10.2028		
EUR 100 Kepler SpA, 6,141 %, fällig 18.12.2029 *	120	0,37	100 Bausch + Lomb Netherlands BV and Bausch + Lomb Inc, 5,891 %, fällig 15.01.2031 *		
EUR 200 Mundys SpA, 3,700 %, fällig 29.09.2031	237	0,74	EUR 100 Beach Acquisition Bidco LLC, 5,250 %, fällig 15.07.2032		
EUR 100 Nexture SpA, 5,145 %, fällig 30.07.2032 *	118	0,37	211 Beach Acquisition Bidco LLC, 144A, 10,000 %, fällig 15.07.2033		
EUR 150 Prysmian SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028	181	0,56			
EUR 100 Webuild SpA, 7,000 %, fällig 27.09.2028	128	0,40			
EUR 100 X3G Mergeco SpA, 7,000 %, fällig 15.05.2030	108	0,33			
	2.124	6,61			
Jamaika – 0,65 %					
200 Digicel International Finance Ltd / DiFi US LLC, 144A, 8,625 %, fällig 01.08.2032	208	0,65			
Japan – 0,37 %					
EUR 100 SoftBank Group Corp, 5,000 %, fällig 15.04.2028	121	0,37			
Jersey – 0,37 %					
GBP 100 Waga Bondco Ltd, 8,500 %, fällig 15.06.2030	119	0,37			

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
45 Beacon Mobility Corp, 144A, 7,250 %, fällig 01.08.2030	47	0,15	50 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 10,000 %, fällig 15.02.2031	51	0,16
45 Big River Steel LLC / BRS Finance Corp, 144A, 6,625 %, fällig 31.01.2029	45	0,14	65 Discovery Communications LLC, 4,125 %, fällig 15.05.2029	64	0,20
95 Black Pearl Compute LLC, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2031	97	0,30	50 Discovery Global Holdings Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2042	35	0,11
95 Block Communications Inc, 144A, 10,250 %, fällig 01.03.2031	87	0,27	105 Dornoch Debt Merger Sub Inc, 144A, 6,625 %, fällig 15.10.2029	95	0,30
40 Boeing Co/The, 5,875 %, fällig 15.02.2040	42	0,13	90 EchoStar Corp, 10,750 %, fällig 30.11.2029	98	0,31
45 Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	45	0,14	65 Element Solutions Inc, 144A, 3,875 %, fällig 01.09.2028	64	0,20
65 Boyd Gaming Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2031	64	0,20	165 Encore Capital Group Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2030	177	0,55
30 Builders FirstSource Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.03.2034	31	0,10	85 Energy Transfer LP, Series B, 6,625 %, Ewige Anleihe *	86	0,27
30 Builders FirstSource Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.05.2035	31	0,10	60 EquipmentShare.com Inc, 144A, 8,625 %, fällig 15.05.2032	64	0,20
140 CACI International Inc, 144A, 6,375 %, fällig 15.06.2033	144	0,45	130 EW Scripps Co/The, 144A, 9,875 %, fällig 15.08.2030	131	0,41
90 Caesars Entertainment Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.10.2029	88	0,27	30 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 4,625 %, fällig 15.01.2029	29	0,09
40 Caesars Entertainment Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.02.2030	41	0,13	140 Fertitta Entertainment LLC / Fertitta Entertainment Finance Co Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2030	132	0,41
30 Caesars Entertainment Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.10.2032	29	0,09	180 FirstCash Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2032	186	0,58
40 Calumet Specialty Products Partners LP / Calumet Finance Corp, 144A, 9,750 %, fällig 15.02.2031	43	0,13	60 FMC Corp, 8,450 %, fällig 01.11.2055 *	40	0,12
80 Carnival Corp, 144A, 5,125 %, fällig 01.05.2029	81	0,25	50 Fortress Intermediate 3 Inc, 144A, 7,500 %, fällig 01.06.2031	49	0,15
70 Carnival Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2031	73	0,23	50 Freedom Mortgage Corp, 144A, 12,250 %, fällig 01.10.2030	54	0,17
65 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.08.2032	68	0,21	155 Freedom Mortgage Holdings LLC, 144A, 8,375 %, fällig 01.04.2032	156	0,49
30 Carnival Corp, 144A, 6,125 %, fällig 15.02.2033	31	0,10	115 Global Partners LP / GLP Finance Corp, 144A, 7,125 %, fällig 01.07.2033	119	0,37
60 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 5,375 %, fällig 01.06.2029	60	0,19	75 Gray Media Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2031	59	0,18
140 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.03.2030	135	0,42	90 Gray Media Inc, 144A, 9,625 %, fällig 15.07.2032	94	0,29
45 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2031	42	0,13	25 Gray Media Inc, 144A, 7,250 %, fällig 15.08.2033	26	0,08
245 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	228	0,71	62 Guidewire Software Inc, 1,250 %, fällig 01.11.2029	62	0,19
120 CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.02.2033	123	0,38	60 Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co, 144A, 8,375 %, fällig 01.11.2033	63	0,20
30 Chefs' Warehouse Inc/The, 2,375 %, fällig 15.12.2028	52	0,16	185 Hilton Domestic Operating Co Inc, 144A, 5,750 %, fällig 15.09.2033	189	0,59
27 Chobani Holdco II LLC, 144A, 8,750 %, fällig 01.10.2029	29	0,09	100 Industrial F&B Investments III Inc, 144A, 7,750 %, fällig 11.02.2033	103	0,32
55 Chobani LLC / Chobani Finance Corp Inc, 144A, 7,625 %, fällig 01.07.2029	57	0,18	10 Insulet Corp, 144A, 6,500 %, fällig 01.04.2033	10	0,03
155 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 5,250 %, fällig 15.05.2030	149	0,46	155 IQVIA Inc, 144A, 6,250 %, fällig 01.06.2032	160	0,50
42 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	46	0,14	190 Iron Mountain Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2033	194	0,60
60 CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 9,750 %, fällig 15.01.2034	63	0,20	165 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	166	0,52
75 Cipher Compute LLC, 144A, 7,125 %, fällig 15.11.2030	78	0,24	115 Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,750 %, fällig 01.05.2033	118	0,37
50 Clarios Global LP / Clarios US Finance Co, 144A, 6,750 %, fällig 15.09.2032	52	0,16	140 Jefferson Capital Holdings LLC, 144A, 9,500 %, fällig 15.02.2029	148	0,46
65 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,875 %, fällig 01.04.2030	69	0,21	50 Jefferson Capital Holdings LLC, 144A, 8,250 %, fällig 15.05.2030	52	0,16
105 Clear Channel Outdoor Holdings Inc, 144A, 7,500 %, fällig 15.03.2033	113	0,35	5 JH North America Holdings Inc, 144A, 5,875 %, fällig 31.01.2031	5	0,02
60 Clearway Energy Operating LLC, 144A, 3,750 %, fällig 15.02.2031	57	0,18	30 JH North America Holdings Inc, 144A, 6,125 %, fällig 31.07.2032	31	0,10
65 Clearway Energy Operating LLC, 144A, 3,750 %, fällig 15.01.2032	61	0,19	25 K Hovnanian Enterprises Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.04.2031	26	0,08
60 Clearway Energy Operating LLC, 144A, 5,750 %, fällig 15.01.2034	61	0,19	35 K Hovnanian Enterprises Inc, 144A, 8,375 %, fällig 01.10.2033	36	0,11
45 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,000 %, fällig 15.03.2032	46	0,14	120 Kinetik Holdings LP, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2030	122	0,38
30 Cleveland-Cliffs Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.01.2034	31	0,10	60 Kodiak Gas Services LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2029	62	0,19
80 Cloud Software Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 31.03.2029	79	0,24	45 Kodiak Gas Services LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.10.2033	46	0,14
100 Cloud Software Group Inc, 144A, 9,000 %, fällig 30.09.2029	98	0,31	25 Kodiak Gas Services LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.10.2035	26	0,08
75 Clydesdale Acquisition Holdings Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.04.2032	76	0,24	20 Kohl's Corp, 144A, 10,000 %, fällig 01.06.2030	22	0,07
210 Cogent Communications Group LLC / Cogent Finance Inc, 144A, 6,500 %, fällig 01.07.2032	186	0,58	70 LGI Homes Inc, 144A, 8,750 %, fällig 15.12.2028	73	0,23
105 Concentra Health Services Inc, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	110	0,34	30 Live Nation Entertainment Inc, 3,125 %, fällig 15.01.2029	48	0,15
EUR 120 Constellium SE, 3,125 %, fällig 15.07.2029	141	0,44	25 Magnera Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.11.2029	23	0,07
EUR 100 Constellium SE, 5,375 %, fällig 15.08.2032	125	0,39	70 Magnera Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.11.2031	69	0,21
105 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2034	109	0,34	70 Mauser Packaging Solutions Holding Co, 144A, 7,875 %, fällig am 15.04.2030	72	0,22
65 Crescent Energy Finance LLC, 144A, 144A, 7,875 %, fällig 15.04.2032	66	0,21	50 Mauser Packaging Solutions Holding Co, 144A, 9,250 %, fällig am 15.04.2030	49	0,15
75 CrossCountry Intermediate HoldCo LLC, 144A, 6,500 %, fällig 01.10.2030	75	0,23	50 McAfee Corp, 144A, 7,375 %, fällig 15.02.2030	41	0,13
120 CrossCountry Intermediate HoldCo LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.12.2032	119	0,37	75 McGraw-Hill Education Inc, 144A, 8,000 %, fällig 01.08.2029	75	0,23
EUR 100 CVS Health Corp, 7,000 %, fällig 10.03.2055 *	105	0,33	100 McGraw-Hill Education Inc, 144A, 7,375 %, fällig 01.09.2031	102	0,32
100 Darling Global Finance BV, 4,500 %, fällig 15.07.2032	121	0,38	95 Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, fällig 01.04.2029	94	0,29
160 DaVita Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.09.2032	166	0,52	145 Millrose Properties Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.08.2030	149	0,46
10 DaVita Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.07.2033	10	0,03	65 Miter Brands Acquisition Holdco Inc / MIWD Borrower LLC, 144A, 6,750 %, fällig 01.04.2032	66	0,20
135 Directv Financing LLC, 144A, 8,875 %, fällig 01.02.2030	135	0,42	100 MKS Inc, 4,250 %, fällig 15.02.2034	118	0,37
11 Directv Financing LLC / Directv Financing Co-Obligor Inc, 144A, 5,875 %, fällig 15.08.2027	11	0,03	EUR 115 Mohegan Tribal Gaming Authority / MS Digital Entertainment Holdings LLC, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2030	120	0,37
			EUR 100 MPT Operating Partnership LP / MPT Finance Corp, 7,000 %, fällig 15.02.2032	125	0,39

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 3,31 %		
1.064 JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	1.064	3,31
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 1.064 \$)		
	1.064	3,31
Stammaktien – 0,09 %		
USA – 0,09 %		
1 GFL Environmental Inc	28	0,09
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 29 \$)		
	28	0,09
Vorzugsaktien – 0,76 %		
USA – 0,76 %		
1 Apollo Global Management Inc	33	0,10
1 Boeing Co/The	70	0,22
1 NextEra Energy Inc	70	0,22
2 Oracle Corp, Series D	71	0,22
	244	0,76
Summe Vorzugsaktien (Anschaffungskosten 215 \$)		
	244	0,76
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 30.872 \$)		
	32.270	100,42
Devisenterminkontrakte – 0,04 %		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)	12	0,04
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
	32.282	100,46
Devisenterminkontrakte – -1,15 %		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)	-368	-1,15
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
	-368	-1,15
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten		
	31.914	99,31
Sonstige Verbindlichkeiten übersteigende Vermögenswerte		
	221	0,69
Gesamt Nettovermögen		
	32.135 \$	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 53	Verkauf GBP 39	\$ -
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 5.092	Verkauf USD 6.074	-54
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 13.283	Verkauf USD 18.166	-264
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 114	Verkauf EUR 96	1
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 775	Verkauf EUR 659	-4
17. März 2026	Barclays	Kauf USD 2	Verkauf EUR 2	-
17. März 2026	Citi	Kauf USD 121	Verkauf EUR 103	-
17. März 2026	Citi	Kauf USD 238	Verkauf EUR 200	2
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 235	Verkauf EUR 199	-1
17. März 2026	HSBC	Kauf USD 6.319	Verkauf EUR 5.365	-25
17. März 2026	HSBC	Kauf USD 120	Verkauf EUR 100	2
17. März 2026	HSBC	Kauf USD 880	Verkauf GBP 659	-8
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 536	Verkauf EUR 458	-6
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 780	Verkauf EUR 654	6
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 400	Verkauf GBP 300	-4
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf EUR 101	Verkauf USD 119	-
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf EUR 317	Verkauf USD 373	1
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf USD 125	Verkauf EUR 107	-2
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 12
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				-368
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten				\$ -356

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 5,35 %		
GBP 3 Invesco EQQQ Nasdaq-100 UCITS ETF – ETF	1.930	2,63
1.999 JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	1.999	2,72
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 3.832 \$)	3.929	5,35
Stammaktien – 94,59 %		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 0,84 %		
– TransDigm Group Inc	618	0,84
Automobilhersteller – 3,84 %		
7 Tesla Inc	2.824	3,84
Baumaterialien – 2,74 %		
3 Trane Technologies Plc	1.217	1,66
3 Vulcan Materials Co	795	1,08
	2.012	2,74
Chemie – 0,76 %		
2 Sherwin-Williams Co/The	560	0,76
Computer – 9,87 %		
27 Apple Inc	7.249	9,87
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 6,41 %		
3 Capital One Financial Corp	593	0,81
4 Mastercard Inc	2.143	2,92
5 Nasdaq Inc	438	0,59
5 Visa Inc 'A'	1.533	2,09
	4.707	6,41
Strom – 0,82 %		
2 Constellation Energy Corp	605	0,82
Unterhaltung – 0,68 %		
3 Live Nation Entertainment Inc	496	0,68
Gesundheit – Produkte – 2,30 %		
6 Boston Scientific Corp	428	0,58
1 IDEXX Laboratories Inc	390	0,53
2 Intuitive Surgical Inc	874	1,19
	1.692	2,30
Gesundheit – Dienstleistungen – 0,71 %		
CHF 1 Lonza Group AG	525	0,71
Internet – 16,51 %		
14 Alphabet Inc	4.380	5,96
15 Amazon.com Inc	3.140	4,28
5 Meta Platforms Inc 'A'	3.453	4,70
6 Netflix Inc	608	0,83
1 Spotify Technology SA	542	0,74
	12.123	16,51
Beherbergung – 1,06 %		
3 Hilton Worldwide Holdings Inc	781	1,06
Maschinen – Bau u. Bergbau: 4,25 %		
2 Caterpillar Inc	1.201	1,64
2 GE Vernova Inc	1.920	2,61
	3.121	4,25
Pharma – 6,13 %		
6 AbbVie Inc	1.319	1,80
3 Eli Lilly & Co	2.688	3,66
CHF 3 Galderma Group AG	494	0,67
	4.501	6,13
Immobilien – 0,94 %		
5 CBRE Group Inc 'A'	687	0,94
Einzelhandel – 2,85 %		
1 Costco Wholesale Corp	1.471	2,00
6 Starbucks Corp	624	0,85
	2.095	2,85

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 216	Verkauf EUR 183	\$ -1
13. März 2026	BNY	Kauf USD 213	Verkauf EUR 180	1
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 958	Verkauf USD 1.129	3
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 32.338	Verkauf USD 38.579	-342
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 4
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				-343
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten				\$ -339

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinven- tarwert
Halbleiter – 19,30 %		
6 Advanced Micro Devices Inc	1.123	1,53
14 Broadcom Inc	4.500	6,13
8 Lam Research Corp	1.835	2,50
38 NVIDIA Corp	6.714	9,14
	14.172	19,30
Software – 12,43 %		
4 Cadence Design Systems Inc	1.223	1,67
15 Microsoft Corp	5.704	7,77
4 Oracle Corp	523	0,71
5 Palantir Technologies Inc	652	0,89
5 ServiceNow Inc	573	0,78
3 Snowflake Inc	451	0,61
	9.126	12,43
Telekommunikation – 1,24 %		
7 Arista Networks Inc	914	1,24
Transportwesen – 0,91 %		
8 Canadian Pacific Kansas City Ltd	668	0,91
Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 63.946 \$)	69.476	94,59
Real Estate Investment Trusts – 0,75 %		
REITs – 0,75 %		
3 American Tower Corp	552	0,75
Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 594 \$)	552	0,75
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen (Anschaffungskosten 68.372 \$)	73.957	100,69
Devisenterminkontrakte – 0,01 %		
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	4	0,01
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte	73.961	100,70
Devisenterminkontrakte – -0,47 %		
Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
	-343	-0,47
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten	-343	-0,47
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	73.618	100,23
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-172	-0,23
Gesamtvermögen	73.446 \$	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
CHF – Schweizer Franken
GBP – Britisches Pfund Sterling

Verteilung des Gesamtvermögens

Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	94,65
Organismen für gemeinsame Anlagen	5,31
Finanzderivate	0,01
Sonstige Vermögenswerte	0,03
Gesamtvermögen	100,00

FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Organismen für gemeinsame Anlagen – 7,65 %			Beherbergung – 1,22 %		
39.566 JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	39.566	7,65	20 Hilton Worldwide Holdings Inc	6.315	1,22
Summe Organismen für gemeinsame Anlagen (Anschaffungskosten 39.566 \$)			39.566	7,65	
Stammaktien – 93,80 %			Maschinen – Diversifiziert – 2,23 %		
Luft- und Raumfahrt u. Verteidigung – 3,19 %			57 Ingersoll Rand Inc	5.390	1,04
11 Northrop Grumman Corp	8.073	1,56	66 Otis Worldwide Corp	6.137	1,19
42 RTX Corp	8.413	1,63		11.527	2,23
	16.486	3,19	Medien – 0,80 %		
Landwirtschaft – 2,51 %			10 Charter Communications Inc	2.237	0,43
70 Philip Morris International Inc	12.996	2,51	61 Comcast Corp	1.903	0,37
Fluggesellschaften – 1,87 %				4.140	0,80
196 Southwest Airlines Co	9.651	1,87	Bergbau – 1,75 %		
Automobilhersteller – 2,31 %			133 Freeport-McMoRan Inc	9.060	1,75
152 General Motors Co	11.921	2,31	Öl u. Gas – 6,27 %		
Banken – 9,87 %			46 ConocoPhillips	5.180	1,00
211 Bank of America Corp	10.499	2,03	100 Exxon Mobil Corp	15.188	2,94
170 Citigroup Inc	18.736	3,62	150 Shell Plc	6.220	1,20
8 Goldman Sachs Group Inc/The	6.756	1,31	29 Valero Energy Corp	5.847	1,13
18 JPMorgan Chase & Co	5.352	1,04		32.435	6,27
33 PNC Financial Services Group Inc/The	7.049	1,36	Verpackung u. Behälter – 0,44 %		
21 State Street Corp	2.658	0,51	34 Ball Corp	2.250	0,44
	51.050	9,87	Pharma – 7,62 %		
Getränke – 2,43 %			20 AbbVie Inc	4.749	0,92
154 Coca-Cola Co/The	12.559	2,43	36 AstraZeneca Plc	7.572	1,47
Biotechnologie – 3,34 %			31 Becton Dickinson & Co	5.521	1,07
101 Corvea Inc	8.052	1,56	13 McKesson Corp	12.478	2,41
12 Regeneron Pharmaceuticals Inc	9.192	1,78	81 Novo Nordisk A.S ADR	3.050	0,59
	17.244	3,34	EUR 61 Sanofi SA	6.009	1,16
Baumaterialien – 2,15 %				39.379	7,62
60 CRH Plc	7.230	1,40	Einzelhandel – 2,91 %		
27 Johnson Controls International plc	3.892	0,75	28 BJ's Wholesale Club Holdings Inc	2.782	0,54
	11.122	2,15	5 Lululemon Athletica Inc	940	0,18
Chemie – 0,91 %			27 Target Corp	3.075	0,60
24 Eastman Chemical Co	1.813	0,35	64 Walmart Inc	8.244	1,59
23 PPG Industries Inc	2.895	0,56		15.041	2,91
	4.708	0,91	Halbleiter – 1,47 %		
Gewerbliche Dienstleistungen – 0,96 %			56 Marvell Technology Inc	4.567	0,88
6 United Rentals Inc	4.973	0,96	21 QUALCOMM Inc	3.038	0,59
Computer – 2,65 %				7.605	1,47
32 Accenture Plc 'A'	6.778	1,31	Software – 2,10 %		
17 Seagate Technology Holdings Plc	6.938	1,34	28 Microsoft Corp	10.851	2,10
	13.716	2,65	Telekommunikation – 4,25 %		
Kosmetik u. Körperpflege – 1,62 %			195 Cisco Systems Inc	15.468	2,99
50 Procter & Gamble Co/The	8.389	1,62	30 T-Mobile US Inc	6.480	1,26
Diversifizierte Finanzdienstleistungen – 6,60 %				21.948	4,25
39 Apollo Global Management Inc	4.104	0,79	Transportwesen – 1,93 %		
5 Blackrock Inc	4.974	0,96	26 FedEx Corp	9.999	1,93
49 Capital One Financial Corp	9.533	1,85	Summe Stammaktien (Anschaffungskosten 449.366 \$)		
85 Charles Schwab Corp/The	8.116	1,57	449.366	484.958	93,80
23 CME Group Inc	7.380	1,43	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 0,26 %		
	34.107	6,60	Staatsanleihen – 0,26 %		
Strom – 4,29 %			150 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig		
130 NextEra Energy Inc	12.223	2,36	23.04.2026 ±	149	0,03
28 NRG Energy Inc	5.002	0,97	1.220 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig		
127 PPL Corp	4.939	0,96	16.07.2026 ±	1.204	0,23
	22.164	4,29		1.353	0,26
Elektronik – 2,09 %			Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 1.353 \$)		
44 Honeywell International Inc	10.781	2,09		1.353	0,26
Gesundheit – Produkte – 2,96 %			Real Estate Investment Trusts – 1,81 %		
63 Boston Scientific Corp	4.814	0,93	REITS – 1,81 %		
18 Thermo Fisher Scientific Inc	9.181	1,77	8 American Tower Corp	1.545	0,30
4 Waters Corp	1.331	0,26	38 Prologis Inc	5.440	1,05
	15.326	2,96	85 Vornado Realty Trust	2.347	0,46
Gesundheit – Dienstleistungen – 1,12 %				9.332	1,81
20 UnitedHealth Group Inc	5.807	1,12	Summe Real Estate Investment Trusts (Anschaffungskosten 9.341 \$)		
Bauunternehmen – 1,95 %				9.332	1,81
74 PulteGroup Inc	10.095	1,95	Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Anlagen und verpfändeten Anlagen (Anschaffungskosten 499.626 \$)		
Versicherungen – 2,31 %				535.209	103,52
32 Allstate Corp/The	6.821	1,32	Devisenterminkontrakte – 0,02 %		
64 American International Group Inc	5.114	0,99	Nicht realisierte Wertsteigerung aus Kontrakten (siehe unten)		
	11.935	2,31		112	0,02
Internet – 5,68 %			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte		
61 Alphabet Inc 'A'	18.866	3,65		535.321	103,54
50 Amazon.com Inc	10.512	2,03	Devisenterminkontrakte – -0,09 %		
	29.378	5,68	Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-494	-0,09
			Futures – -0,01 %		
			Nicht realisierte Wertminderung aus Kontrakten (siehe unten)		
				-61	-0,01
			Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Verbindlichkeiten		
				-555	-0,10

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Anteile (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Summe der ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte und Verbindlichkeiten	534.766	103,44
Sonstige das Vermögen übersteigende Verbindlichkeiten	-17.736	-3,44
Gesamtnettovermögen	517.030 \$	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 (in seiner Gesamtheit oder in Teilen) ist zum 28. Februar 2026 als Sicherheit für den Handel mit Derivaten verpfändet.

ABKÜRZUNGEN:	
ADR	– American Depositary Receipt
EUR	– Euro

Verteilung des Gesamtvermögens	% des Gesamtvermögens
Übertragbare Wertpapiere, die an einer amtlichen Börse notiert sind oder in einem geregelten Markt gehandelt werden	91,43
Organismen für gemeinsame Anlagen	7,30
Finanzderivate	0,02
Sonstige Vermögenswerte	1,25
Gesamtvermögen	100,00

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	Verkauf Währung (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf USD 141	Verkauf EUR 118	\$ –
13. März 2026	BNY	Kauf USD 124	Verkauf EUR 105	–
13. März 2026	BNY	Kauf CHF 457	Verkauf USD 598	-3
13. März 2026	BNY	Kauf GBP 1	Verkauf USD 1	–
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 35.714	Verkauf USD 42.604	-377
13. März 2026	BNY	Kauf EUR 13.355	Verkauf USD 15.753	39
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 350	Verkauf EUR 295	1
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf USD 3.657	Verkauf EUR 3.096	-5
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf GBP 1.841	Verkauf USD 2.473	8
17. März 2026	Barclays	Kauf USD 863	Verkauf EUR 731	-1
17. März 2026	Barclays	Kauf EUR 410	Verkauf USD 485	1
17. März 2026	Citi	Kauf USD 495	Verkauf EUR 421	-3
17. März 2026	Citi	Kauf USD 2.828	Verkauf GBP 2.102	-6
17. März 2026	Citi	Kauf EUR 679	Verkauf USD 802	1
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 419	Verkauf EUR 355	–
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 2.301	Verkauf GBP 1.689	24
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf USD 553	Verkauf GBP 412	-2
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf EUR 3.996	Verkauf USD 4.710	16
17. März 2026	HSBC	Kauf USD 2.422	Verkauf EUR 2.057	-10
17. März 2026	HSBC	Kauf USD 1.825	Verkauf GBP 1.359	-6
17. März 2026	JP Morgan	Kauf USD 3.527	Verkauf GBP 2.626	-12
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 2.755	Verkauf DKK 17.437	-5
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 4.909	Verkauf EUR 4.166	-18
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 1.415	Verkauf EUR 1.191	6
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf USD 1.190	Verkauf GBP 891	-11
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf EUR 246	Verkauf USD 290	–
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf USD 1.212	Verkauf EUR 1.028	-4
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf USD 1.714	Verkauf GBP 1.284	-16
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf EUR 337	Verkauf USD 398	1
17. März 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf EUR 4.054	Verkauf USD 4.780	15
17. März 2026	UBS	Kauf USD 597	Verkauf EUR 506	-2
17. März 2026	UBS	Kauf USD 490	Verkauf GBP 367	-5
17. März 2026	Westpac Banking Corporation	Kauf USD 1.230	Verkauf DKK 7.786	-2
17. März 2026	Westpac Banking Corporation	Kauf USD 585	Verkauf GBP 439	-6
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten				\$ 112
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten				-494
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten				\$ -382

Aufstellung der Futures-Kontrakte

Gegenpartei	Nennwert	Nominalwert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
S&P 500 Index März 2026	Bank of America Merrill Lynch	19 \$ 6.545	\$ -61
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten			\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten			-61
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten			\$ -61

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam Balanced Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert	Nennwert (in Tsd.)	Wert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Hypothekenbesicherte Wertpapiere – 7,76 %			72 American Electric Power Co Inc, Series C, 5,800 %, fällig 15.03.2056 *	72	0,03
2.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,000 % ±	1.657	0,75	27 American Electric Power Co Inc, Series D, 6,050 %, fällig 15.03.2056 *	27	0,01
1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 2,500 % ±	867	0,39	83 American Tower Corp, 3,125 %, fällig 15.01.2027	82	0,04
1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,000 % ±	904	0,41	240 American Tower Corp, 2,700 %, fällig 15.04.2031	223	0,10
1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 3,500 % ±	942	0,43	15 American Tower Corp, 4,700 %, fällig 15.12.2032	15	0,01
1.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,000 % ±	1.005	0,46	91 American Transmission Systems Inc, 144A, 2,650 %, fällig 15.01.2032	83	0,04
2.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 5,500 % ±	2.032	0,92	82 Amgen Inc, 5,250 %, fällig 02.03.2030	86	0,04
3.000 Fannie Mae or Freddie Mac, 30 year, TBA, 6,000 % ±	3.078	1,40	6 Amgen Inc, 5,650 %, fällig 02.03.2053	6	–
861 Fannie Mae Pool 'CA7528', 2,500 %, fällig 01.10.2050	749	0,34	46 Amgen Inc, 5,750 %, fällig 02.03.2063	46	0,02
190 Fannie Mae Pool 'CB3770', 3,500 %, fällig 01.06.2052	179	0,08	55 Amphenol Corp, 4,400 %, fällig 15.02.2033	55	0,03
312 Fannie Mae Pool 'FA0740', 4,500 %, fällig 01.03.2055	309	0,14	46 Analog Devices Inc, 5,050 %, fällig 01.04.2034	48	0,02
84 Fannie Mae Pool 'FA2095', 6,000 %, fällig 01.07.2055	87	0,04	29 Appalachian Power Co, Series L, 5,800 %, fällig 01.10.2035	31	0,01
439 Fannie Mae Pool 'FS3275', 3,000 %, fällig 01.04.2052	399	0,18	75 AptarGroup Inc, 4,750 %, fällig 30.03.2031	76	0,03
27 Fannie Mae Pool 'MA4404', 2,500 %, fällig 01.08.2036	26	0,01	37 Ares Capital Corp, 7,000 %, fällig 15.01.2027	38	0,02
111 Fannie Mae Pool 'MA5054', 4,000 %, fällig 01.06.2052	108	0,05	123 Arthur J Gallagher & Co, 4,850 %, fällig 15.12.2029	126	0,06
110 Fannie Mae Pool 'MA5553', 5,500 %, fällig 01.12.2054	112	0,05	58 AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,021 %, fällig 20.10.2029	59	0,03
91 Freddie Mac Pool 'SD8491', 5,000 %, fällig 01.12.2054	91	0,04	45 AT&T Inc, 2,250 %, fällig 01.02.2032	40	0,02
544 Freddie Mac Pool 'SL1735', 2,000 %, fällig 01.12.2051	452	0,20	85 AT&T Inc, 2,550 %, fällig 01.12.2033	74	0,03
193 Ginnie Mae II Pool 'MA7936', 2,500 %, fällig 20.03.2052	171	0,08	40 AT&T Inc, 5,125 %, fällig 30.04.2036	41	0,02
367 Ginnie Mae II Pool 'MA8098', 3,000 %, fällig 20.06.2052	337	0,15	43 AT&T Inc, 4,750 %, fällig 15.05.2046	38	0,02
253 Ginnie Mae II Pool 'MA8487', 3,500 %, fällig 20.12.2052	240	0,11	120 Athene Global Funding, 144A, 5,322 %, fällig 13.11.2031	122	0,06
88 Ginnie Mae II Pool 'MA9965', 5,500 %, fällig 20.10.2054	90	0,04	36 Athene Global Funding, 144A, 5,543 %, fällig 22.08.2035	36	0,02
212 Ginnie Mae II Pool 'MB0025', 5,000 %, fällig 20.11.2054	213	0,10	100 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,375 %, fällig 15.07.2029	103	0,05
1.000 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 5,500 % ±	1.013	0,46	9 Aviation Capital Group LLC, 144A, 5,125 %, fällig 10.04.2030	9	–
2.000 Ginnie Mae, 30 year, TBA, 6,000 % ±	2.040	0,93	50 Bank of America Corp, 2,551 %, fällig 04.02.2028 *	49	0,02
Summe hypothekenbesicherte Wertpapiere (Anschaffungskosten 16.851 \$)	17.101	7,76	46 Bank of America Corp, 5,468 %, fällig 23.01.2035 *	48	0,02
Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen – 10,71 %			54 Bank of America Corp, 5,425 %, fällig 15.08.2035 *	55	0,03
Australien – 0,26 %			296 Bank of America Corp, 3,846 %, fällig 08.03.2037 *	280	0,13
400 Commonwealth Bank of Australia, 144A, 5,837 %, fällig 13.03.2034	426	0,19	31 Becton Dickinson & Co, 2,823 %, fällig 20.05.2030	30	0,01
57 Glencore Funding LLC, 144A, 2,500 %, fällig 01.09.2030	53	0,03	9 Berkshire Hathaway Finance Corp, 4,300 %, fällig 15.05.2043	8	–
46 Glencore Funding LLC, 144A, 5,634 %, fällig 04.04.2034	49	0,02	38 Berry Global Inc, 1,650 %, fällig 15.01.2027	37	0,02
54 Westpac Banking Corp, 4,421 %, fällig 24.07.2039	50	0,02	112 Biogen Inc, 2,250 %, fällig 01.05.2030	104	0,05
	578	0,26	40 Boeing Co/The, 6,298 %, fällig 01.05.2029	43	0,02
Kanada – 0,28 %			9 Boeing Co/The, 2,950 %, fällig 01.02.2030	9	–
57 Alimentation Couche-Tard Inc, 144A, 2,950 %, fällig 25.01.2030	55	0,02	138 Boeing Co/The, 5,150 %, fällig 01.05.2030	143	0,07
200 Bank of Montreal, 7,700 %, fällig 26.05.2084 *	212	0,10	31 Boeing Co/The, 6,125 %, fällig 15.02.2033	34	0,02
11 Fairfax Financial Holdings Ltd, 4,850 %, fällig 17.04.2028	11	0,01	249 Boeing Co/The, 3,600 %, fällig 01.05.2034	230	0,10
95 Rogers Communications Inc, 5,000 %, fällig 15.02.2029	97	0,04	40 Boeing Co/The, 3,500 %, fällig 01.03.2039	34	0,02
136 Rogers Communications Inc, 3,800 %, fällig 15.03.2032	130	0,06	153 Boeing Co/The, 3,375 %, fällig 15.06.2046	110	0,05
109 TELUS Corp, 6,625 %, fällig 15.10.2055 *	113	0,05	51 Boeing Co/The, 3,900 %, fällig 01.05.2049	39	0,02
	618	0,28	48 Boeing Co/The, 6,858 %, fällig 01.05.2054	55	0,03
Irland – 0,27 %			99 Broadcom Inc, 4,150 %, fällig 15.11.2030	99	0,05
150 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 4,125 %, fällig 28.02.2029	150	0,07	35 Broadcom Inc, 4,950 %, fällig 15.01.2036	36	0,02
300 AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,300 %, fällig 30.01.2032	280	0,13	52 Broadcom Inc, 144A, 3,187 %, fällig 15.11.2036	45	0,02
110 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 5,750 %, fällig 15.11.2029	115	0,05	98 Broadcom Inc, 144A, 4,926 %, fällig 15.05.2037	98	0,04
40 Avolon Holdings Funding Ltd, 144A, 4,900 %, fällig 10.10.2030	41	0,02	5 Broadcom Inc, 5,700 %, fällig 15.01.2056	5	–
	586	0,27	95 Brown & Brown Inc, 4,900 %, fällig 23.06.2030	97	0,04
Israel – 0,01 %			11 Brown & Brown Inc, 5,250 %, fällig 23.06.2032	11	0,01
25 Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV, 4,100 %, fällig 01.10.2046	19	0,01	41 Brunswick Corp/DE, 2,400 %, fällig 18.08.2031	36	0,02
Italien – 0,09 %			20 Burlington Northern Santa Fe LLC, 5,550 %, fällig 15.03.2056	20	0,01
200 Enel Finance International NV, 144A, 4,375 %, fällig 30.09.2030	201	0,09	27 Capital One Financial Corp, 4,493 %, fällig 11.09.2031 *	27	0,01
Spanien – 0,09 %			59 Capital One Financial Corp, 7,624 %, fällig 30.10.2031 *	67	0,03
200 CaixaBank SA, 144A, 5,673 %, fällig 15.03.2030 *	209	0,09	65 Capital One Financial Corp, 4,722 %, fällig 30.01.2032 *	65	0,03
Vereinigtes Königreich – 0,37 %			62 Carlisle Cos Inc, 5,250 %, fällig 15.09.2035	64	0,03
424 BAE Systems Plc, 144A, 5,300 %, fällig 26.03.2034	447	0,20	330 Carnival Corp, 144A, 4,000 %, fällig 01.08.2028	328	0,15
110 BAT Capital Corp, 4,625 %, fällig 22.03.2033	111	0,05	503 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 15.03.2030	521	0,24
118 BAT Capital Corp, 4,390 %, fällig 15.08.2037	110	0,05	20 Carnival Corp, 144A, 5,750 %, fällig 01.08.2032	21	0,01
62 Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 144A, 5,150 %, fällig 17.03.2030	63	0,03	25 Celanese US Holdings LLC, 1,400 %, fällig 05.08.2026	25	0,01
85 Macquarie Airfinance Holdings Ltd, 144A, 6,500 %, fällig 26.03.2031	92	0,04	64 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 2,250 %, fällig 15.01.2029	60	0,03
	823	0,37	26 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 5,850 %, fällig 01.12.2035	26	0,01
USA – 9,34 %			133 Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 3,500 %, fällig 01.06.2041	96	0,04
95 7-Eleven Inc, 144A, 1,300 %, fällig 10.02.2028	90	0,04	46 Cheniere Energy Partners LP, 4,500 %, fällig 01.10.2029	46	0,02
141 7-Eleven Inc, 144A, 1,800 %, fällig 10.02.2031	125	0,06	34 Cheniere Energy Partners LP, 3,250 %, fällig 31.01.2032	32	0,01
45 AbbVie Inc, 4,400 %, fällig 15.03.2033	45	0,02	145 Cipher Compute LLC, 144A, 7,125 %, fällig 15.11.2030	151	0,07
73 AbbVie Inc, 5,050 %, fällig 15.03.2034	76	0,03	90 Citigroup Inc, 4,450 %, fällig 29.09.2027	91	0,04
15 AbbVie Inc, 4,750 %, fällig 15.03.2036	15	0,01	311 Citigroup Inc, 6,174 %, fällig 25.05.2034 *	332	0,15
212 Alexander Funding Trust II, 144A, 4,767 %, fällig 31.07.2028	226	0,10	100 Citigroup Inc, 6,625 %, Ewige Anleihe *	103	0,05
104 Ally Financial Inc, 8,000 %, fällig 01.11.2031	118	0,05	123 Citigroup Inc, Series GG, 6,875 %, Ewige Anleihe *	126	0,06
35 Alphabet Inc, 4,800 %, fällig 15.02.2036	36	0,02	46 CNA Financial Corp, 5,125 %, fällig 15.02.2034	47	0,02
24 American Electric Power Co Inc, Series J, 4,300 %, fällig 01.12.2028	24	0,01	4 CNO Global Funding, 144A, 4,950 %, fällig 09.09.2029	4	–
			46 Columbia Pipelines Operating Co LLC, 144A, 5,927 %, fällig 15.08.2030	49	0,02
			39 Comcast Corp, 3,450 %, fällig 01.02.2050	27	0,01

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam Balanced Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
34 Commonwealth Edison Co, Series 100, 5,875 %, fällig 01.02.2033	37	0,02	59 JBS NV/JBS USA Foods Group Holdings Inc/JBS USA Food Co Holdings, 5,950 %, fällig 20.04.2035	63	0,03
60 Constellation Energy Generation LLC, 5,600 %, fällig 01.03.2028	62	0,03	75 Jefferies Financial Group Inc, 4,500 %, fällig 15.09.2026	75	0,03
30 Constellation Energy Generation LLC, 4,400 %, fällig 15.01.2031	30	0,01	90 JPMorgan Chase & Co, 3,782 %, fällig 01.02.2028 *	90	0,04
48 Constellation Energy Generation LLC, 6,125 %, fällig 15.01.2034	53	0,02	198 JPMorgan Chase & Co, 5,717 %, fällig 14.09.2033 *	210	0,10
50 Constellation Energy Generation LLC, 6,500 %, fällig 01.10.2053	55	0,03	9 JPMorgan Chase & Co, 5,502 %, fällig 24.01.2036 *	10	–
46 Constellation Energy Generation LLC, 5,750 %, fällig 15.03.2054	46	0,02	26 JPMorgan Chase & Co, 5,576 %, fällig 23.07.2036 *	27	0,01
46 Corebridge Financial Inc, 3,850 %, fällig 05.04.2029	46	0,02	375 JPMorgan Chase & Co, 4,898 %, fällig 22.01.2037 *	377	0,17
46 Crown Castle Inc, 3,650 %, fällig 01.09.2027	46	0,02	21 JPMorgan Chase & Co, Series KK, 3,650 %, Ewige Anleihe *	21	0,01
190 Crown Castle Inc, 4,900 %, fällig 01.09.2029	194	0,09	35 Kellanova, Series B, 7,450 %, fällig 01.04.2031	40	0,02
8 Crown Castle Inc, 4,750 %, fällig 15.05.2047	7	–	40 Kellanova, 4,500 %, fällig 01.04.2046	36	0,02
35 CVS Health Corp, 1,875 %, fällig 28.02.2031	31	0,01	121 Kenvue Inc, 4,850 %, fällig 22.05.2032	125	0,06
98 CVS Health Corp, 4,780 %, fällig 25.03.2038	94	0,04	9 KKR Group Finance Co VI LLC, 144A, 3,750 %, fällig 01.07.2029	9	–
80 CVS Health Corp, 7,000 %, fällig 10.03.2055 *	84	0,04	10 Kraft Heinz Foods Co, 6,875 %, fällig 26.01.2039	11	0,01
67 Dick's Sporting Goods Inc, 3,150 %, fällig 15.01.2032	62	0,03	100 Kraft Heinz Foods Co, 4,625 %, fällig 01.10.2039	92	0,04
44 Dominion Energy Inc, 6,200 %, fällig 15.02.2056 *	45	0,02	155 Kraft Heinz Foods Co, 5,000 %, fällig 04.06.2042	142	0,06
7 DR Horton Inc, 5,000 %, fällig 15.10.2034	7	–	60 LPL Holdings Inc, 144A, 4,000 %, fällig 15.03.2029	59	0,03
29 DT Midstream Inc, 144A, 5,800 %, fällig 15.12.2034	31	0,01	155 LPL Holdings Inc, 5,200 %, fällig 15.03.2030	158	0,07
10 DTE Electric Co, 5,250 %, fällig 15.05.2035	10	0,01	50 Marriott International Inc/MD, 4,500 %, fällig 01.05.2033	50	0,02
45 DTE Electric Co, Series A, 4,850 %, fällig 01.03.2036	45	0,02	16 Mars Inc, 144A, 5,000 %, fällig 01.03.2032	17	0,01
103 DTE Energy Co, 4,950 %, fällig 01.07.2027	104	0,05	76 Mars Inc, 144A, 5,200 %, fällig 01.03.2035	79	0,04
50 DTE Energy Co, 5,850 %, fällig 01.06.2034	54	0,02	91 Mars Inc, 144A, 5,650 %, fällig 01.05.2045	93	0,04
43 Duke Energy Carolinas LLC, 4,250 %, fällig 15.12.2041	39	0,02	129 Mars Inc, 144A, 5,700 %, fällig 01.05.2055	131	0,06
47 Duke Energy Corp, 4,850 %, fällig 05.01.2029	47	0,02	46 Mars Inc, 144A, 5,800 %, fällig 01.05.2065	47	0,02
50 Duke Energy Corp, 5,750 %, fällig 15.09.2033	54	0,02	46 Marvell Technology Inc, 5,750 %, fällig 15.02.2029	48	0,02
63 Eastern Energy Gas Holdings LLC, 5,800 %, fällig 15.01.2035	68	0,03	46 Marvell Technology Inc, 5,950 %, fällig 15.09.2033	49	0,02
29 Eastern Energy Gas Holdings LLC, 5,650 %, fällig 15.10.2054	29	0,01	395 Medline Borrower LP, 144A, 3,875 %, fällig 01.04.2029	389	0,18
156 Energy Transfer LP, 5,200 %, fällig 01.04.2030	162	0,07	10 Merck & Co Inc, 4,450 %, fällig 04.12.2032	10	–
9 Energy Transfer LP, 6,500 %, fällig 01.02.2042	10	–	20 Merck & Co Inc, 4,750 %, fällig 04.12.2035	20	0,01
11 EPR Properties, 4,500 %, fällig 01.06.2027	11	0,01	40 Morgan Stanley, 5,123 %, fällig 01.02.2029 *	41	0,02
55 Equinix Asia Financing Corp Pte Ltd, 4,400 %, fällig 15.03.2031	55	0,03	205 Morgan Stanley, Series I, 4,133 %, fällig 18.10.2029 *	205	0,09
60 Equinix Inc, 3,200 %, fällig 18.11.2029	58	0,03	101 Morgan Stanley, 5,230 %, fällig 15.01.2031 *	105	0,05
100 Exelon Corp, 5,150 %, fällig 15.03.2029	103	0,05	45 Morgan Stanley, 4,493 %, fällig 16.01.2032 *	45	0,02
39 Exelon Corp, 5,625 %, fällig 15.06.2035	41	0,02	50 Morgan Stanley, 5,073 %, fällig 30.01.2037 *	50	0,02
46 Fifth Third Bancorp, 6,339 %, fällig 27.07.2029 *	48	0,02	148 Morgan Stanley, 5,948 %, fällig 19.01.2038 *	156	0,07
24 First-Citizens Bank & Trust Co, 6,125 %, fällig 09.03.2028	25	0,01	79 Morgan Stanley, 5,942 %, fällig 07.02.2039 *	83	0,04
200 Foundry JV Holdco LLC, 144A, 6,150 %, fällig 25.01.2032	215	0,10	54 Motorola Solutions Inc, 4,850 %, fällig 15.08.2030	56	0,03
240 Foundry JV Holdco LLC, 144A, 5,900 %, fällig 25.01.2033	255	0,12	93 Motorola Solutions Inc, 2,300 %, fällig 15.11.2030	86	0,04
400 Foundry JV Holdco LLC, 144A, 6,400 %, fällig 25.01.2038	436	0,20	29 Motorola Solutions Inc, 5,200 %, fällig 15.08.2032	30	0,01
17 General Motors Financial Co Inc, 4,200 %, fällig 27.10.2028	17	0,01	178 MSCI Inc, 144A, 3,625 %, fällig 01.09.2030	170	0,08
20 General Motors Financial Co Inc, 4,900 %, fällig 06.10.2029	20	0,01	45 Netflix Inc, 144A, 5,375 %, fällig 15.11.2029	47	0,02
27 General Motors Financial Co Inc, 5,450 %, fällig 06.09.2034	28	0,01	74 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 5,300 %, fällig 15.03.2032	78	0,04
46 Georgia Power Co, 4,950 %, fällig 17.05.2033	48	0,02	82 NextEra Energy Capital Holdings Inc, 5,900 %, fällig 15.03.2055	83	0,04
46 Georgia Power Co, 5,250 %, fällig 15.03.2034	48	0,02	50 NiSource Inc, 5,200 %, fällig 01.07.2029	52	0,02
87 Georgia-Pacific LLC, 144A, 2,100 %, fällig 30.04.2027	85	0,04	95 Novartis Capital Corp, 4,100 %, fällig 05.11.2030	96	0,04
75 GLP Capital LP / GLP Financing II Inc, 3,250 %, fällig 15.01.2032	68	0,03	48 NRG Energy Inc, 144A, 2,450 %, fällig 02.12.2027	47	0,02
29 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,223 %, fällig 01.05.2029 *	29	0,01	6 Oncor Electric Delivery Co LLC, 5,750 %, fällig 15.03.2029	6	–
167 Goldman Sachs Group Inc/The, 4,153 %, fällig 21.10.2029 *	167	0,08	43 Oncor Electric Delivery Co LLC, 4,950 %, fällig 15.09.2052	39	0,02
30 Goldman Sachs Group Inc/The, 5,065 %, fällig 21.01.2037 *	30	0,01	9 ONEOK Inc, 4,750 %, fällig 15.10.2031	9	–
540 HALEON US Capital LLC, 3,625 %, fällig 24.03.2032	520	0,24	33 Oracle Corp, 4,450 %, fällig 26.09.2030	32	0,01
148 HCA Inc, 3,625 %, fällig 15.03.2032	141	0,06	80 Oracle Corp, 4,950 %, fällig 04.02.2031	80	0,04
27 HCA Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	27	0,01	39 Oracle Corp, 4,800 %, fällig 26.09.2032	38	0,02
85 Hewlett Packard Enterprise Co, 4,550 %, fällig 15.10.2029	86	0,04	85 Oracle Corp, 5,700 %, fällig 04.02.2036	85	0,04
29 Howmet Aerospace Inc, 6,750 %, fällig 15.01.2028	31	0,01	66 Oracle Corp, 3,650 %, fällig 25.03.2041	49	0,02
181 Howmet Aerospace Inc, 3,000 %, fällig 15.01.2029	177	0,08	30 Oracle Corp, 6,700 %, fällig 04.02.2056	29	0,01
110 Howmet Aerospace Inc, 4,550 %, fällig 15.11.2032	112	0,05	2 Pacific Gas and Electric Co, 2,100 %, fällig 01.08.2027	2	–
40 Howmet Aerospace Inc, 5,950 %, fällig 01.02.2037	44	0,02	112 Pacific Gas and Electric Co, 3,300 %, fällig 01.12.2027	111	0,05
56 Hyatt Hotels Corp, 5,250 %, fällig 30.06.2029	58	0,03	41 Pacific Gas and Electric Co, 5,900 %, fällig am 15.06.2032	44	0,02
135 Hyundai Capital America, 144A, 6,500 %, fällig 16.01.2029	143	0,07	20 Pacific Gas and Electric Co, 5,200 %, fällig 01.05.2036	20	0,01
10 Hyundai Capital America, 144A, 5,400 %, fällig 23.06.2032	11	0,01	47 Pacific Gas and Electric Co, 6,750 %, fällig am 15.01.2053	51	0,02
85 Intel Corp, 4,150 %, fällig 05.08.2032	83	0,04	6 Paramount Global, 4,200 %, fällig 01.06.2029	6	–
42 Intercontinental Exchange Inc, 1,850 %, fällig 15.09.2032	36	0,02	9 Paramount Global, 4,200 %, fällig 19.05.2032	8	–
54 JBS NV/JBS USA Foods Group Holdings Inc/JBS USA Food Co Holdings, 3,000 %, fällig 02.02.2029	53	0,02	63 Paychex Inc, 5,100 %, fällig 15.04.2030	64	0,03
			68 Penske Truck Leasing Co Lp / PTL Finance Corp, 144A, 4,400 %, fällig 01.07.2027	68	0,03
			8 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,750 %, fällig 19.05.2033	8	–
			4 Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 5,300 %, fällig 19.05.2053	4	–
			74 Philip Morris International Inc, 5,125 %, fällig 15.02.2030	77	0,04
			121 Philip Morris International Inc, 4,000 %, fällig 29.10.2030	121	0,06
			102 Philip Morris International Inc, 4,750 %, fällig 01.11.2031	105	0,05
			82 Pilgrim's Pride Corp, 3,500 %, fällig 01.03.2032	77	0,04
			193 PNC Financial Services Group Inc/The, 4,626 %, fällig 06.06.2033 *	193	0,09
			5 PNC Financial Services Group Inc/The, 5,373 %, fällig 21.07.2036 *	5	–
			43 Puget Sound Energy Inc, 5,448 %, fällig 01.06.2053	42	0,02
			183 Regeneron Pharmaceuticals Inc, 1,750 %, fällig 15.09.2030	165	0,08
			73 Republic Services Inc, 5,000 %, fällig 15.11.2029	76	0,03

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam Balanced Fund^

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (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)					
29 Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	30	0,01	290 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 30.09.2027	290	0,13
51 Royalty Pharma Plc, 2,200 %, fällig 02.09.2030	47	0,02	1.030 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.10.2027	1.031	0,47
96 Royalty Pharma Plc, 5,400 %, fällig 02.09.2034	100	0,05	750 United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 30.11.2027	750	0,34
10 Royalty Pharma Plc, 5,200 %, fällig 25.09.2035	10	–	180 United States Treasury Note/Bond, 3,500 %, fällig 31.01.2028	180	0,08
170 S&P Global Inc, 2,500 %, fällig 01.12.2029	162	0,07	220 United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 31.12.2029	227	0,10
46 Sempra, 5,500 %, fällig 01.08.2033	49	0,02	2.890 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.05.2030	2.949	1,34
41 ServiceNow Inc, 1,400 %, fällig 01.09.2030	36	0,02	2.960 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	3.006	1,36
9 Southern Co Gas Capital Corp, 4,950 %, fällig 15.09.2034	9	–	1.770 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2030	1.779	0,81
83 Southern Power Co, Series A, 4,250 %, fällig 01.10.2030	83	0,04	1.470 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 30.09.2030	1.478	0,67
27 Southern Power Co, Series B, 4,900 %, fällig 01.10.2035	27	0,01	7.280 United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.01.2031	7.355	3,34
335 Spirit AeroSystems Inc, 4,600 %, fällig 15.06.2028	338	0,15	700 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.08.2032	708	0,32
60 Sprint Capital Corp, 6,875 %, fällig 15.11.2028	64	0,03	330 United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.12.2032	333	0,15
55 SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	55	0,03	260 United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 15.11.2033	272	0,12
154 Synopsys Inc, 5,150 %, fällig 01.04.2035	158	0,07	2.680 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	2.828	1,28
46 Tapestry Inc, 5,100 %, fällig 11.03.2030	48	0,02	950 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.05.2035	975	0,44
9 Tapestry Inc, 5,500 %, fällig 11.03.2035	9	–	1.580 United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	1.620	0,73
40 Targa Resources Corp, 4,350 %, fällig 15.04.2031	40	0,02	460 United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2035	462	0,21
46 Targa Resources Partners LP / Targa Resources Partners Finance Corp, 4,875 %, fällig 01.02.2031	47	0,02	330 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.02.2045	338	0,15
40 Thermo Fisher Scientific Inc, 4,902 %, fällig 12.02.2036	41	0,02	5.330 United States Treasury Note/Bond, 5,000 %, fällig 15.05.2045	5.636	2,56
88 Time Warner Cable Enterprises LLC, 8,375 %, fällig 15.07.2033	103	0,05	860 United States Treasury Note/Bond, 4,875 %, fällig 15.08.2045	895	0,41
41 T-Mobile USA Inc, 3,750 %, fällig 15.04.2027	41	0,02	90 United States Treasury Note/Bond, 1,250 %, fällig 15.05.2050	45	0,02
41 T-Mobile USA Inc, 5,050 %, fällig 15.07.2033	42	0,02	260 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	265	0,12
79 T-Mobile USA Inc, 6,700 %, fällig 15.12.2033	89	0,04	2.200 United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055	2.241	1,02
61 T-Mobile USA Inc, 4,950 %, fällig 15.11.2035	62	0,03	1.630 United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.11.2055	1.628	0,74
65 T-Mobile USA Inc, 5,000 %, fällig 15.02.2036	65	0,03		38.460	17,45
21 Toll Brothers Finance Corp, 4,350 %, fällig 15.02.2028	21	0,01	Summe Staatsanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 37.887 \$)		
35 Transcontinental Gas Pipe Line Co LLC, 144A, 5,100 %, fällig 15.03.2036	36	0,02		38.460	17,45
78 UnitedHealth Group Inc, 5,300 %, fällig 15.06.2035	81	0,04	Stammaktien – 59,85 %		
11 US Bancorp, 2,491 %, fällig 03.11.2036 *	10	–	Australien – 0,20 %		
75 Verizon Communications Inc, 2,355 %, fällig 15.03.2032	67	0,03	GBP 61 Glencore Plc	437	0,20
40 Verizon Communications Inc, 4,750 %, fällig 15.01.2033	41	0,02	Kanada – 0,52 %		
45 Verizon Communications Inc, 5,401 %, fällig 02.07.2037	46	0,02	8 Barrick Mining Corp	391	0,18
20 Verizon Communications Inc, 5,875 %, fällig 30.11.2055	20	0,01	CAD 34 Cenovus Energy Inc	749	0,34
182 Vertiv Group Corp, 144A, 4,125 %, fällig 15.11.2028	181	0,08		1.140	0,52
65 Vertiv Holdings Co, 4,850 %, fällig 15.03.2036	65	0,03	Frankreich – 0,35 %		
20 Vertiv Holdings Co, 5,800 %, fällig 15.03.2056	20	0,01	EUR 3 Airbus SE	650	0,29
46 VICI Properties LP, 5,750 %, fällig 01.04.2034	48	0,02	EUR 3 AXA SA	126	0,06
50 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 3,750 %, fällig 15.02.2027	50	0,02		776	0,35
92 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 4,500 %, fällig 15.01.2028	92	0,04	Hongkong – 0,21 %		
44 VICI Properties LP / VICI Note Co Inc, 144A, 3,875 %, fällig 15.02.2029	43	0,02	GBP 30 Prudential Plc	459	0,21
143 Viper Energy Partners LLC, 4,900 %, fällig 01.08.2030	146	0,07	Schweiz – 0,08 %		
26 Viper Energy Partners LLC, 5,700 %, fällig 01.08.2035	27	0,01	4 On Holding AG	179	0,08
46 Virginia Electric and Power Co, 5,050 %, fällig 15.08.2034	47	0,02	USA – 58,49 %		
50 Virginia Electric and Power Co, Series C, 4,900 %, fällig 15.09.2035	50	0,02	2 Abbott Laboratories	203	0,09
90 Virginia Electric and Power Co, 4,950 %, fällig 15.03.2036	90	0,04	5 AbbVie Inc	1.133	0,51
135 Vistra Corp, 144A, 8,000 %, Ewige Anleihe *	138	0,06	8 Advanced Micro Devices Inc	1.636	0,74
41 Vistra Operations Co LLC, 144A, 3,700 %, fällig 30.01.2027	41	0,02	5 Allstate Corp/The	1.148	0,52
65 Vistra Operations Co LLC, 144A, 4,300 %, fällig 15.07.2029	65	0,03	23 Alphabet Inc 'A'	7.187	3,26
27 Vistra Operations Co LLC, 144A, 4,600 %, fällig 15.10.2030	27	0,01	26 Amazon.com Inc	5.534	2,51
83 Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,950 %, fällig 15.10.2033	93	0,04	5 Ameren Corp	596	0,27
46 Vistra Operations Co LLC, 144A, 6,000 %, fällig 15.04.2034	49	0,02	8 American International Group Inc	662	0,30
35 Vistra Operations Co LLC, 144A, 5,250 %, fällig 15.10.2035	35	0,02	– Amgen Inc	31	0,01
41 Waste Connections Inc, 4,250 %, fällig 01.12.2028	41	0,02	9 Analog Devices Inc	3.126	1,42
50 Waste Connections Inc, 5,000 %, fällig 01.03.2034	52	0,02	6 Antero Resources Corp	219	0,10
46 Waste Management Inc, 4,875 %, fällig 15.02.2029	47	0,02	1 Aon Plc	437	0,20
88 Wells Fargo & Co, Series BB, 3,900 %, Ewige Anleihe *	88	0,04	5 Apollo Global Management Inc	547	0,25
42 WestRock MWV LLC, 7,950 %, fällig 15.02.2031	49	0,02	24 Apple Inc	6.426	2,92
9 Williams Cos Inc/The, 5,600 %, fällig 15.03.2035	9	–	5 Arch Capital Group Ltd	466	0,21
29 Xcel Energy Inc, 5,600 %, fällig 15.04.2035	30	0,01	1 Assured Guaranty Ltd	115	0,05
46 Zoetis Inc, 2,000 %, fällig 15.05.2030	43	0,02	14 Bank of America Corp	702	0,32
101 Zoetis Inc, 5,000 %, fällig 17.08.2035	103	0,05	2 Becton Dickinson & Co	418	0,19
	20.583	9,34	3 Berkshire Hathaway Inc 'B'	1.509	0,68
Summe Unternehmensanleihen und Schuldverschreibungen (Anschaffungskosten 23.313 \$)			2 Bio-Rad Laboratories Inc	557	0,25
Staatsanleihen und Schuldverschreibungen – 17,45 %			3 BJ's Wholesale Club Holdings Inc	325	0,15
USA – 17,45 %					
500 United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 23.04.2026 ≠	497	0,23			
670 United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2027	672	0,31			

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Putnam Balanced Fund[^]

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)			Verkauf Währung (in Tsd.)		Nicht realisierte Wertsteigerung/- minderung aus Kontrakten (in Tsd.)	
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	57	Verkauf	EUR	49	\$ –
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	188	Verkauf	GBP	140	-1
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	39	Verkauf	GBP	29	–
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	13	Verkauf	SEK	119	–
17. März 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	GBP	330	Verkauf	USD	445	-1
17. März 2026	Barclays	Kauf	USD	88	Verkauf	EUR	74	–
17. März 2026	Barclays	Kauf	USD	137	Verkauf	GBP	102	-1
17. März 2026	Citi	Kauf	USD	20	Verkauf	EUR	17	–
17. März 2026	Citi	Kauf	USD	50	Verkauf	EUR	42	–
17. März 2026	Citi	Kauf	USD	58	Verkauf	GBP	42	1
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	100	Verkauf	EUR	85	–
17. März 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	291	Verkauf	GBP	217	-1
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD	24	Verkauf	EUR	20	–
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD	60	Verkauf	EUR	51	–
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD	252	Verkauf	GBP	187	-1
17. März 2026	HSBC	Kauf	USD	128	Verkauf	GBP	93	2
17. März 2026	HSBC	Kauf	GBP	20	Verkauf	USD	27	–
17. März 2026	JP Morgan	Kauf	USD	9	Verkauf	DKK	59	–
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD	133	Verkauf	EUR	113	-1
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD	329	Verkauf	GBP	241	5
17. März 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD	352	Verkauf	GBP	263	-2
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD	110	Verkauf	EUR	92	1
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD	46	Verkauf	EUR	39	–
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	USD	101	Verkauf	GBP	75	-1
17. März 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	GBP	18	Verkauf	USD	25	–
17. März 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD	57	Verkauf	EUR	50	–
17. März 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD	292	Verkauf	SEK	2.676	-6
17. März 2026	UBS	Kauf	USD	46	Verkauf	DKK	289	–
17. März 2026	UBS	Kauf	USD	37	Verkauf	EUR	32	–
17. März 2026	UBS	Kauf	USD	77	Verkauf	GBP	58	-1
17. März 2026	Westpac Banking Corporation	Kauf	USD	4	Verkauf	EUR	4	–
15. Apr. 2026	Bank of America Merrill Lynch	Kauf	USD	48	Verkauf	CAD	65	-1
15. Apr. 2026	Barclays	Kauf	USD	132	Verkauf	CAD	182	-2
15. Apr. 2026	Citi	Kauf	USD	404	Verkauf	CAD	550	-1
15. Apr. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	132	Verkauf	CAD	182	-2
15. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD	22	Verkauf	CAD	30	–
15. Apr. 2026	HSBC	Kauf	USD	22	Verkauf	CAD	30	–
15. Apr. 2026	Morgan Stanley	Kauf	USD	127	Verkauf	CAD	175	-1
15. Apr. 2026	State Street Bank & Trust Co	Kauf	CAD	5	Verkauf	USD	4	–
15. Apr. 2026	Toronto-Dominion Bank	Kauf	USD	99	Verkauf	CAD	137	-1
15. Apr. 2026	UBS	Kauf	USD	79	Verkauf	CAD	110	-1
13. Mai. 2026	Barclays	Kauf	HKD	169	Verkauf	USD	22	–
13. Mai. 2026	Goldman Sachs	Kauf	USD	8	Verkauf	HKD	66	–
13. Mai. 2026	HSBC	Kauf	USD	12	Verkauf	HKD	97	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten							\$	9
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten								-25
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten							\$	-16

Aufstellung der Futures-Kontrakte

	Gegenpartei	Nenn- wert	Nominal- wert (in Tsd.)	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
S&P 500 Index März 2026	Bank of America Merrill Lynch	3	\$ 1.033	\$ -8
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten				\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten				-8
Nettowertminderung aus Futures-Kontrakten				\$ -8

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Anlagenportfolio zum 28. Februar 2026

Aufstellung der Devisenterminkontrakte

Fälligkeitsdatum	Gegenpartei	Kauf Währung (in Tsd.)	3	Verkauf Währung (in Tsd.)	2	Nicht realisierte Wertsteigerung/ Wertminderung aus Kontrakten (in Tsd.)
13. März 2026	BNY	Kauf SGD	3	Verkauf USD	2	\$ –
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten						\$ –
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten						–
Nettowertminderung aus Devisenterminkontrakten						\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 1	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 11.368	\$ 42.180	€ 54	€ 54
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	591	857	1.312	1.944	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	2.068.066	1.705.250	78.279	100.247	176.352	238.432	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	193	14	–	–
Optionen	–	–	12	287	15	551	–	–
Swapkontrakte	–	–	61	259	236	632	–	–
Swaptions	–	–	40	–	94	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	111	232	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	105	212	256	1.256	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	50	3.992	1.477	15.418	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	97	4	22	1.192	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	4.950	5.208	524	695	1.391	1.789	–	–
Dividendenforderungen	–	–	1	1	1	1	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	2	1	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	2.073.019	1.710.459	79.760	106.554	192.828	303.641	54	54
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	48	116	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	156	324	102	692	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	1.266	–	–	–	–
Optionen	–	–	7	155	17	337	–	–
Swapkontrakte	–	–	60	190	88	706	–	–
Swaptions	–	–	36	–	85	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	312	296	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	17	20	208	634	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	24.733	785	6.253	13.634	51.223	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	4.020	3.908	93	107	85	97	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	911	785	45	58	104	148	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	49	41	12	13	19	24	–	3
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	3	5	7	8	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	20	28	984	357	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	273	236	176	117	439	346	54	51
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	5.253	29.703	1.458	8.652	16.084	54.868	54	54
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 2.067.766	\$ 1.680.756	\$ 78.302	\$ 97.902	\$ 176.744	\$ 248.773	€ –	€ –
(in Tsd.)	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 [^]		FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 15	\$ 15	\$ 17	\$ 17	\$ 8	\$ 8	\$ 46	\$ 256
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	350	657
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	–	–	–	–	121.519	190.698
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	251	89
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	28	21
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	25	111
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	1.557	1.939
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	–	1
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	15	15	17	17	8	8	123.776	193.772
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	197	49
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	1
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	88	176
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	13	12
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	51	94
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	15	19
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	8	12
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1	1	–	–	–	–	89	280
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	14	14	17	17	8	8	257	170
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	15	15	17	17	8	8	718	813
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 123.058	\$ 192.959

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 [^]		FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 668 –	\$ 671 –	\$ 9.164 1.465	\$ 18.668 1.601	\$ 177 238	\$ 2 787	\$ 24 –	\$ 24 –	\$ 526 139	\$ 899 165
–	–	176.212	220.071	79.460	88.135	–	–	38.699	40.625
–	–	87	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	1	26	–	–	–	35
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	398	613	–	10	–	–	33	39
–	–	13	62	34	65	–	–	15	57
–	–	477	–	129	–	–	–	79	–
–	–	353	378	295	207	–	–	210	37
–	–	2.222	2.785	1.086	1.179	–	–	525	537
–	–	13	17	–	2	–	–	1	1
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	1	–	–	4	–
668	671	190.404	244.195	81.420	90.414	24	24	40.231	42.395
–	–	163	–	–	296	–	–	–	–
–	–	23	73	34	93	–	–	7	99
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	601	–	2	20	–	–	–	–
–	–	–	–	–	11	–	–	–	–
–	–	748	1.070	22	5	–	–	17	65
–	–	220	532	–	–	–	–	39	–
–	–	747	829	1.277	1.762	–	–	816	1.214
–	–	53	68	109	149	–	–	38	59
–	–	99	107	60	59	–	–	30	30
–	–	19	22	12	12	–	–	10	9
–	–	7	7	6	3	–	–	1	–
661	661	63	13	118	971	11	11	421	38
7	10	225	151	104	80	13	13	93	92
668	671	2.968	2.872	1.744	3.461	24	24	1.472	1.606
\$ –	\$ –	\$ 187.436	\$ 241.323	\$ 79.676	\$ 86.953	\$ –	\$ –	\$ 38.759	\$ 40.789
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Bond Fund ^{^*}		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 1.022 2.133	\$ 2.298 1.197	\$ 5.668 812	\$ 7.442 804	\$ 78 541	\$ 206 599	\$ 5.449 –	\$ 4.056 –	\$ 24.119 2.081	\$ 23.004 2.003
181.347	173.951	97.139	97.122	9.975	26.988	–	–	316.600	376.567
–	–	263	37	–	–	–	–	85	–
–	–	5	–	–	–	–	–	–	304
–	–	–	–	–	–	–	–	580	207
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
330	1.358	214	276	47	41	–	–	177	4.968
22	416	177	434	12	107	–	–	366	729
–	–	291	1.792	–	–	–	–	1.826	787
288	119	–	–	–	15	–	–	791	684
1.859	1.541	807	757	137	280	–	–	3.340	4.151
30	15	8	10	1	5	–	–	–	–
–	–	–	–	1	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	1	–
187.031	180.895	105.384	108.674	10.792	28.241	5.449	4.056	349.966	413.404
1	4	–	–	13	129	–	–	–	–
61	45	52	276	6	88	–	–	549	241
–	–	–	96	–	–	–	–	–	–
–	–	5	–	–	–	–	–	–	–
263	240	–	–	50	119	–	–	645	774
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.303	156	949	954	83	21	–	–	4.560	630
558	218	114	263	25	14	–	–	6	428
1.897	–	6.035	9.619	79	668	–	–	6.224	4.039
1	1	–	–	–	–	–	–	–	–
65	65	6	9	–	–	–	–	41	38
19	18	12	12	7	8	–	3	27	33
6	7	–	–	–	–	–	–	–	–
540	1.345	–	2	–	2	2.867	2.653	30	12
190	133	187	112	100	66	2.582	1.400	247	186
4.904	2.232	7.360	11.343	363	1.115	5.449	4.056	12.329	6.381
\$ 182.127	\$ 178.663	\$ 98.024	\$ 97.331	\$ 10.429	\$ 27.126	\$ –	\$ –	\$ 337.637	\$ 407.023

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	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	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ –	\$ 50	\$ 37.499	\$ 36	£ 33	£ 35	\$ –	\$ 47
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	1.915	2.491	1.054	2.916	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	529.606	512.078	1.378.216	1.323.526	–	–	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	884	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	7	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	12	–	360	1.668	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	18.616	81.727	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	2.048	2.038	5.280	5.527	–	–	–	–
Dividendenforderungen	2	1	12	20	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	2	–	4	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	534.469	516.665	1.441.041	1.415.420	33	35	–	47
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	3.892	–	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	199	1.668	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	21.032	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	844	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	14	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	504	1.088	311	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	195.053	171.974	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	6	15	17	14	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	40	40	84	87	–	–	–	3
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	388	319	321	258	33	35	–	44
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	5.689	1.463	195.985	195.033	33	35	–	47
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 528.780	\$ 515.202	\$ 1.245.056	\$ 1.220.387	£ –	£ –	\$ –	\$ –
	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^Δ η		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^Δ π	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)								
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 395	\$ –	\$ 1	\$ 9.973	\$ 115	\$ –	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	381	60	341	3.298	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	200.976	179.233	736.823	891.471	–	11.060	–	–
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	123	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	1.790	1.206	293	3.659	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	713	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	1	1.075	482	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	2.307	1.448	8.903	12.358	–	149	–	–
Dividendenforderungen	4	602	5	8	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	1	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	205.853	182.550	747.565	921.962	115	11.209	–	–
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	617	260	3	–	132	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	1.170	270	590	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	239	–	80	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	1.616	1.908	2.467	3.340	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	3.318	–	6.310	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	69	128	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	98	93	405	533	–	5	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	19	19	54	70	5	8	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1	–	42	57	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2	293	2.263	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	404	136	557	245	110	87	–	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	6.626	3.045	11.047	6.878	115	312	–	–
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 199.227	\$ 179.505	\$ 736.518	\$ 915.084	\$ –	\$ 10.897	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]		FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^{^π}		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 87 499	\$ 543 428	\$ – –	\$ 16 –	\$ – 1	\$ 3.259 –	\$ 117 1.076	\$ 1 2.826	\$ 6 75	\$ – 67
18.334	17.368	–	–	47.609	60.562	45.786	131.020	68.514	42.417
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
3	104	–	–	–	–	–	–	–	–
129	136	–	–	–	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–	–	–	–	–
16	36	–	–	136	515	642	1.531	52	1
76	73	–	–	–	–	110	104	27	23
25	35	–	–	–	–	–	–	–	150
–	–	–	–	2	14	–	–	365	99
159	150	–	–	418	345	545	1.554	1.018	682
–	–	–	–	1	333	–	100	–	1
6	6	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	1	1
19.342	18.879	–	16	48.167	65.028	48.276	137.136	70.058	43.441
4	–	–	–	29	1	–	232	–	4
–	–	–	–	–	–	3	290	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
4	67	–	–	–	–	–	–	–	–
40	112	–	–	–	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–	–	–	–	–
18	39	–	–	728	154	577	2.008	8	232
91	157	–	–	–	–	135	234	–	–
505	126	–	–	472	–	253	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	54	43
–	–	–	–	23	43	30	96	39	18
9	17	–	2	10	11	10	15	11	8
–	–	–	–	5	5	–	1	1	–
–	–	–	–	77	3.487	1	–	19	–
92	44	–	14	212	173	302	228	94	49
770	562	–	16	1.556	3.874	1.311	3.104	226	354
\$ 18.572	\$ 18.317	\$ –	\$ –	\$ 46.611	\$ 61.154	\$ 46.965	\$ 134.032	\$ 69.832	\$ 43.087
FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund [^]		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{^π}	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 16 –	\$ 14 –	\$ 92 –	\$ 95 –	\$ 45 –	\$ 51 –	\$ 8 –	\$ 11 72	\$ – –	\$ 5 –
–	–	–	–	–	15	35.164	36.607	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	22	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	169	144	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	1	1	–	–
16	14	92	95	45	66	35.342	36.857	–	5
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	3	3	–	1
–	–	–	3	3	5	7	12	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
16	14	–	–	–	17	–	–	–	–
–	–	92	92	42	44	54	25	–	4
16	14	92	95	45	66	64	40	–	5
\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 35.278	\$ 36.817	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		FTGF Putnam US Research Fund [*]	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 5	\$ –	\$ 8.106	\$ 40.351	\$ 17	\$ 17	\$ 6.225	\$ 3.152
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	69.450	–	617.248	1.140.429	–	–	1.444.390	179.506
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	2.781	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	8	802	–	–	54	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	1.151	48.617	–	–	24.569	4
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	11	2	–	–	–	1
Dividendenforderungen	91	–	559	751	–	–	858	99
Verwaltungsgebühren	13	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	1	–	3	1	–	–	16	–
Gesamtumlaufvermögen	69.560	–	627.086	1.230.953	17	17	1.478.893	182.762
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	6	–	1.039	5.207	–	–	3	398
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	47	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	335	2	–	–	1.759	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	289	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	430	791	–	–	405	185
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	15	–	68	100	–	–	96	23
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	49	94	–	–	19	23
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	2.009	9.226	17	17	3.215	261
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	137	–	251	164	–	–	190	112
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	158	–	4.181	15.584	17	17	6.023	1.002
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 69.402	\$ –	\$ 622.905	\$ 1.215.369	\$ –	\$ –	\$ 1.472.870	\$ 181.760

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund ^{^*}		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	€ 32.720	€ 16.063	\$ 18.415	\$ 6.782	\$ 597	\$ 619	\$ 1.171	\$ 1.637
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	1.198.977	718.183	399.732	281.612	7.908	6.117	1.089.000	984.608
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	1.119	158	94	198	–	–	92	894
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	38.277	–	27.542	–	–	–	10	204
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	11.918	1.443	2.883	53	–	–	3.454	2.407
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	17	13
Dividendenforderungen	2.466	1.703	1.384	1.136	15	12	205	385
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	2	–	–
Sonstige Vermögenswerte	2	–	–	–	1	1	4	–
Gesamtumlaufvermögen	1.285.479	737.550	450.050	289.781	8.521	6.751	1.093.953	990.148
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	1	1	6	2	–	3	3	28
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	319	1.213	340	69	–	–	1.239	154
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	43.758	–	29.209	–	–	–	–	408
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	946	598	301	253	–	–	904	928
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	85	57	30	33	6	28	85	85
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	135	81	36	31	–	–	154	166
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	917	1.257	1.384	2.150	–	–	3.642	3.853
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	208	172	653	94	62	21	266	192
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	46.369	3.379	31.959	2.632	68	52	6.293	5.814
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	€ 1.239.110	€ 734.171	\$ 418.091	\$ 287.149	\$ 8.453	\$ 6.699	\$ 1.087.660	\$ 984.334

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund*		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 14.084	\$ 51.054	\$ 206	\$ 2.372	\$ 1.356	\$ 1.152	\$ 17.447	\$ 7.785	\$ 3.174	\$ 178
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1.388.368	1.948.068	—	175.395	37.646	38.854	615.331	912.104	192.610	27.201
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
1.162	1.978	—	21	3	4	9	926	11	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
792	6.384	—	37	—	549	239	3.614	310	—
—	5	—	—	—	16	—	—	4	—
359	782	—	71	31	21	512	452	73	17
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
12	1	—	—	—	—	1	—	8	1
1.404.777	2.008.272	206	177.896	39.036	40.596	633.539	924.881	196.190	27.397
368	3	—	143	—	—	652	5	1	—
860	2.000	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
525	1.354	—	46	7	10	2.612	3	11	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	1.625	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
915	1.319	—	183	34	35	251	399	166	13
122	166	6	36	10	9	63	85	19	8
128	162	—	27	4	3	25	47	23	—
1.928	2.998	—	518	—	36	1.219	2.729	21	—
377	289	200	214	97	67	301	257	71	47
5.223	8.291	206	1.167	152	160	5.123	3.525	1.937	68
\$1.399.554	\$1.999.981	\$ —	\$ 176.729	\$ 38.884	\$ 40.436	\$ 628.416	\$ 921.356	\$ 194.253	\$ 27.329
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		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 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 611	\$ 57	\$ —	USD —	USD 23	\$ 23	€ 1.557	€ 1.578	\$ 2.224	\$ 2.239
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
89.302	83.316	5.226	4.400	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	2	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	24	—	—	—	—	—	—
103	122	10	—	—	—	—	—	—	—
8	2	—	—	—	—	—	—	—	—
17	16	2	5	—	—	—	4	—	—
—	—	—	1	—	—	—	—	—	—
—	—	3	—	—	—	—	—	—	—
90.041	83.515	5.241	4.430	23	23	1.557	1.582	2.224	2.239
40	309	—	11	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
14	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
—	—	—	47	—	—	—	—	—	—
97	97	—	—	—	—	—	—	—	—
16	14	7	6	—	—	—	—	—	—
15	13	—	—	—	—	—	—	—	—
137	151	—	—	—	—	1.142	1.193	2.211	2.213
100	78	64	44	23	23	415	389	13	26
419	662	71	108	23	23	1.557	1.582	2.224	2.239
\$ 89.622	\$ 82.853	\$ 5.170	\$ 4.322	\$ —	\$ —	€ —	€ —	\$ —	\$ —

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Legg Mason Battery March International Large Cap Fund ^Δ		Legg Mason Q5 Emerging Markets Equity Fund ^Δ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^Δ		Legg Mason Japan Equity Fund ^Δ	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 61	\$ 61	\$ 39	\$ 39	\$ 2.554	\$ 2.552	¥ 131.395	¥ 126.767
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
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 rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	61	61	39	39	2.554	2.552	131.395	126.767
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	59	59	1	1	2.518	2.516	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	2	2	38	38	36	36	131.395	126.767
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	61	61	39	39	2.554	2.552	131.395	126.767
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –

(in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund ^Δ		FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund ^{Δ*}		FTGF Franklin European Unconstrained Fund ^{Δφ*}		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{ΔΩ}	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 17	\$ 23	\$ 1	\$ 16	€ 93	€ 600	\$ 55	\$ 139
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	–	–	20.573	31.871	–	82.397	–	15.267
Verpfändete Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	24
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	392	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	20	–	251
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	5	–	–	–	–	–
Dividendenforderungen	–	–	21	27	–	98	–	3
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	–	6
Sonstige Vermögenswerte	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	17	23	20.600	32.306	93	83.115	55	15.690
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	–	–	9	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	125	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	7	19	–	24	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	2	2	9	9	5	13	5	42
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	34	39	–	4	–	46
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	15	21	260	161	88	57	50	66
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	17	23	319	353	93	98	55	154
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ –	\$ –	\$ 20.281	\$ 31.953	€ –	€ 83.017	\$ –	\$ 15.536

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund ^Δ		Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund ^Δ		Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund ^Δ		Legg Mason Martin Currie Greater China Fund ^Δ		FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund ^{Δ*μ}	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
\$ 34	\$ 41	\$ 28	\$ 28	\$ 51	\$ 51	\$ 61	\$ 61	\$ 85	\$ 31
-	-	-	-	-	-	-	-	-	21.541
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	112
-	-	-	-	-	-	-	-	-	185
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	34
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
34	41	28	28	51	51	61	61	85	21.903
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	2
-	-	-	-	-	-	-	-	-	92
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	9	22
-	-	-	-	-	-	-	-	-	10
-	-	-	-	-	-	-	-	-	1
-	-	-	-	51	51	38	38	-	213
34	41	28	28	-	-	23	23	76	67
34	41	28	28	51	51	61	61	85	407
\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 21.496
Franklin Responsible Income 2028 Fund ^Δ		Franklin Responsible Income 2029 Fund ^Δ		FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund ^{Δ*ψ}		FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund ^{Δ*γ}		FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund ^{Δ*δ}	
Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
€ 72	€ 61	€ 1.684	€ 800	€ 11	€ -	\$ 896	\$ -	\$ 4	\$ -
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
70.490	82.166	35.094	38.422	4.907	-	1.553.245	-	32.076	-
-	-	-	-	-	-	-	-	194	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	1	-	12	-
-	-	-	764	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	79	-	-	-
795	911	500	518	82	-	11.676	-	465	-
14	19	15	16	2	-	-	-	1	-
-	-	-	-	17	-	-	-	-	-
-	-	2	1	1	-	26	-	9	-
71.371	83.157	37.295	40.521	5.020	-	1.565.923	-	32.761	-
-	-	-	-	-	-	-	-	142	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	1	-	368	-
-	-	-	1.329	-	-	22.028	-	55	-
21	28	15	14	-	-	544	-	-	-
8	10	8	7	-	-	568	-	11	-
-	-	-	-	-	-	101	-	7	-
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
404	114	-	-	-	-	1	-	-	-
87	54	52	25	17	-	124	-	43	-
520	206	75	1.375	17	-	23.367	-	626	-
€ 70.851	€ 82.951	€ 37.220	€ 39.146	€ 5.003	€ -	\$1.542.556	\$ -	\$ 32.135	\$ -

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund ^λ		FTGF Putnam US Large Cap Value Fund ^α		FTGF Putnam Balanced Fund ^β		FTGF Putnam Global Healthcare Fund ^θ	
(in Tsd.)	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:								
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 3	\$ –	\$ 1	\$ –	\$ 18.668	\$ –	\$ –	\$ –
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):								
Finanzanlagen	73.957	–	534.095	–	213.744	–	3.950	–
Verpfändete Anlagen	–	–	1.114	–	315	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	4	–	112	–	9	–	–	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	–	–	6.248	–	1.227	–	–	–
Zinsen und sonstige Erträge	–	–	–	–	584	–	–	–
Dividendenforderungen	15	–	526	–	85	–	5	–
Verwaltungsgebühren	–	–	–	–	–	–	4	–
Sonstige Vermögenswerte	9	–	6	–	2	–	–	–
Gesamtumlaufvermögen	73.988	–	542.102	–	234.634	–	3.959	–
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:								
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	24	–	774	–	–	–	–	–
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	–	–	29	–	3	–	–	–
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	343	–	494	–	25	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	61	–	8	–	–	–
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	13.799	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	37	–	229	–	237	–	–	–
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	10	–	39	–	20	–	6	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	5	–	16	–	9	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	98	–	23.411	–	50	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	25	–	19	–	39	–	24	–
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	542	–	25.072	–	14.190	–	30	–
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 73.446	\$ –	\$ 517.030	\$ –	\$ 220.444	\$ –	\$ 3.929	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
UMLAUFVERMÖGEN:		
Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente (Erläuterung 8)	\$ 236.599	\$ 255.064
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	15.004	22.772
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte (Erläuterung 2):		
Finanzanlagen	16.339.796	13.269.306
Verpfändete Anlagen	5.032	51
Optionen	35	1.246
Swapkontrakte	2.014	1.295
Swaptions	142	–
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Devisenterminkontrakten	7.383	19.706
Nicht realisierte Wertsteigerung aus Futures-Kontrakten	1.613	5.962
Forderungen aus verkauften Anlagen (Erläuterung 2)	96.060	105.498
Forderungen aus verkauften rückkaufbaren und gewinnberechtigten Anteilen	58.364	66.899
Zinsen und sonstige Erträge	53.638	46.777
Dividendenforderungen	7.789	6.838
Verwaltungsgebühren	44	15
Sonstige Vermögenswerte	123	9
Gesamtumlaufvermögen	16.823.636	13.801.438
KURZFRISTIGE VERBINDLICHKEITEN:		
Überziehung Barmittel (Erläuterung 8)	7.675	7.693
Margin-Konten und eingeschränkte Barzahlungen (Erläuterung 8)	3.891	6.160
Ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):		
Leerverkaufte Wertpapiere	–	22.394
Optionen	33	559
Swapkontrakte	2.593	2.480
Swaptions	128	11
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	21.960	13.952
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	2.586	3.588
Verbindlichkeiten aus erworbenen Anlagen (Erläuterung 2)	355.826	274.491
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	5.079	4.572
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	7.785	7.147
Fällige Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	1.329	1.263
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	731	757
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	51.165	41.936
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	13.215	8.686
Verbindlichkeiten (abzgl. des Nettovermögens, das Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnen ist)	473.996	395.689
Summe des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens	\$ 16.349.640	\$ 13.405.749

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

Die Euro-Beträge für den TGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] und FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc zum Ende des Geschäftsjahres am 28. Februar 2026 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,8463 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2025: 0,9640).

Die Yen-Beträge für den Legg Mason Japan Equity Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc zum Ende des Geschäftsjahres am 28. Februar 2026 zum USD/JPY-Schlusskurs von 156,1650 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2025: 150,5350).

Die Beträge in britischem Pfund für den FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc zum Ende des Geschäftsjahres am 28. Februar 2026 zum USD/GBP-Schlusskurs von 0,7420 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2025: 0,7950).

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

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

γ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^] den Handel auf.

δ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^] den Handel auf.

λ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^] den Handel auf.

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

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

Ω Mit Wirkung zum 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel ein.

η Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] den Handel ein.

φ Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 stellte der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

Ψ Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] den Handel auf.

π Am 7. Mai 2026 wurden die Genehmigungen für den FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], den FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und den FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

* Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsamen und Verschmelzungen sind den Erläuterungen 14 und 16 zu entnehmen.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Im Namen des Verwaltungsrats

Fionnuala Doris
Verwaltungsratsmitglied

Joseph Keane
Verwaltungsratsmitglied

16. Juni 2026

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 383.204	3.030	126,46	\$ 399.438	3.271	122,10	\$ 243.001	2.080	116,83
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1.462.390	1.462.390	1,00	1.089.810	1.089.823	1,00	737.375	737.387	1,00
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	110,97
Klasse B USD Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	174	174	1,00
Klasse C USD Thesaurierend	180	2	116,54	175	2	113,32	168	2	109,18
Klasse X USD Ausschüttend (D)	221.304	221.304	1,00	190.664	190.666	1,00	133.030	133.032	1,00
Klasse A (G) USD Thesaurierend	499	4	126,72	482	4	122,36	461	4	117,06
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	182	182	1,00	180	180	1,00	201	200	1,00
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	7	7	1,00	7	7	1,00	7	7	1,00
FTGF Western Asset US Core Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 18.971	130	146,36	\$ 27.213	197	137,95	\$ 29.383	224	130,97
Klasse A USD Ausschüttend (D)	27.098	293	92,44	28.195	313	90,14	36.683	414	88,70
Klasse C USD Thesaurierend	1.357	10	133,00	3.121	25	125,98	3.877	32	120,21
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2.286	25	92,49	2.329	26	90,19	2.470	28	88,74
Klasse E USD Thesaurierend	871	9	98,02	1.040	11	93,00	1.002	11	88,85
Klasse F USD Thesaurierend	19.371	143	135,08	25.366	200	126,89	90.592	755	120,02
Klasse F USD Ausschüttend (D)	6.376	70	91,01	9.053	102	88,75	15.485	177	87,33
Klasse X USD Thesaurierend	754	6	118,56	345	3	111,19	1.499	14	105,04
Klasse X USD Ausschüttend (D)	201	2	89,96	201	2	87,72	198	2	86,29
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	12	–	111,71	9	–	105,41
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3.219	36	89,71
Klasse GA USD Thesaurierend	1.017	7	145,07	1.027	8	136,64	1.015	8	129,60
Klasse GE USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	28	–	119,49
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 32.714	205	159,48	\$ 55.688	368	151,49	\$ 94.104	642	146,51
Klasse A USD Ausschüttend (D)	24.184	247	97,97	26.130	272	95,93	29.679	309	95,93
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	2.705	35	77,48	2.834	37	77,35	3.621	46	78,76
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	138	3	72,12	108	2	72,41	516	11	74,45
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	354	3	93,68	429	5	90,98	698	7	89,59
Klasse B USD Ausschüttend (D)	13	–	97,77	12	–	95,74	12	–	95,73
Klasse C USD Thesaurierend	6.623	47	141,96	10.291	76	135,52	16.755	127	131,73
Klasse C USD Ausschüttend (D)	6.353	64	98,67	6.573	68	96,61	8.069	84	96,61
Klasse E USD Thesaurierend	3.349	29	115,71	6.712	61	110,63	11.694	109	107,66
Klasse F USD Thesaurierend	48.879	379	128,84	65.888	541	121,71	415.738	3.552	117,03
Klasse F USD Ausschüttend (D)	5.817	63	91,87	6.956	77	89,96	8.584	95	89,96
Klasse X USD Thesaurierend	2.120	18	120,22	2.026	18	113,46	2.844	26	108,99
Klasse X USD Ausschüttend (D)	–	–	–	1.882	22	83,64	2.994	36	83,64
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	86	1	87,56	119	1	85,64
Klasse Premier USD Thesaurierend	41.388	265	156,07	60.901	414	147,05	202.351	1.435	141,03
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	333	4	92,96	326	4	91,01	4.507	49	91,09
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	103,91	–	–	99,38	–	–	96,22
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	10.586	135	78,43
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	325	3	119,61
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	3	–	150,31	12	–	141,52	34	–	135,77
Klasse A (G) USD Thesaurierend	88	1	161,87	83	1	153,83	174	1	148,81
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	801	8	98,74	786	8	96,68	794	8	96,68
Klasse B (G) USD Ausschüttend (D)	–	–	–	3	–	96,68	3	–	96,68
Klasse L (G) USD Thesaurierend	223	2	147,29	213	2	140,68	207	2	136,77
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	659	7	98,75	834	9	96,70	847	9	96,69
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^A									
Klasse A USD Ausschüttend (D)	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 1.201	13	98,79
Klasse A EUR Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	892	9	94,79
Klasse C USD Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	56	1	98,18
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	5.161	54	95,65
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	41.686	419	99,50
Klasse GA EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	467	4	118,00
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	267	3	106,14
Klasse GE EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	99	1	108,81
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 9.965	54	183,32	\$ 11.359	66	172,94	\$ 11.157	68	163,58
Klasse A USD Ausschüttend (D)	9.901	95	103,86	10.624	104	101,77	10.954	109	100,33
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1.078	12	88,17	1.276	15	86,42	1.479	17	85,24
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	3.091	41	75,92	2.620	34	76,22	1.369	18	77,00
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	283	6	70,80	233	5	71,50	138	3	72,88
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	860	5	144,99	860	6	139,90	1.578	11	134,67
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1.243	15	68,77	1.180	17	68,92	1.525	20	69,13
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	99	2	55,70	147	3	56,59	222	4	57,59
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	335	3	85,09	378	4	83,58	427	4	82,64
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	10	1	73,83	49	5	73,68	49	5	74,93
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	632	1.085	0,74	719	1.279	0,76	929	1.598	0,78
Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	19.145	501	608,31	25.536	759	629,24	7.827	229	654,80
Klasse B USD Ausschüttend (D)	96	1	103,78	103	1	101,69	188	2	100,30
Klasse C USD Thesaurierend	4.775	29	162,54	4.839	31	154,10	5.572	38	146,50
Klasse C USD Ausschüttend (D)	5.403	52	103,83	6.854	67	101,74	7.866	78	100,30
Klasse E USD Thesaurierend	779	5	142,16	1.073	8	134,97	1.175	9	128,46
Klasse E USD Ausschüttend (D)	195	2	86,45	370	4	84,73	453	5	83,54
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	57	–	105,53	49	–	102,45	60	1	99,23
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	130	2	70,14	63	1	70,28	40	1	70,51
Klasse F USD Thesaurierend	24.242	139	173,84	21.553	132	163,08	19.213	125	153,36
Klasse F USD Ausschüttend (D)	3.997	46	86,48	4.311	51	84,74	4.382	52	83,54
Klasse X USD Ausschüttend (D)	263	3	86,56	319	4	84,82	695	8	83,67
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2.242	17	114,34	706	6	109,68	251	2	104,99
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	–	–	–	32	–	79,78	32	–	78,87
Klasse Premier USD Thesaurierend	22.949	108	212,35	38.328	193	198,71	36.527	196	186,39
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	352	3	107,81	356	3	105,67	349	3	104,23
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	71.755	522	105,77	59.720	522	103,38	59.744	522	101,29
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	807	5	148,83	730	5	142,37	781	5	135,82
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	11	–	66,47	13	–	66,58	33	–	66,82
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	192	2	82,14	207	2	80,64	337	3	79,76
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	29	–	70,50	135	2	69,64	135	2	69,27
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	2.445	56	154,97	2.548	71	144,25	2.701	80	134,58
Klasse P2 USD Thesaurierend	1	–	110,19	248	2	102,85	–	–	–
Klasse LM AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	43.659	768	91,67	62.490	1.054	91,24
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	74	–	165,63	129	1	154,60	262	1	144,88
FTGF Western Asset US High Yield Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 13.816	60	230,76	\$ 16.752	78	213,65	\$ 15.896	82	194,34
Klasse A USD Ausschüttend (D)	20.673	291	71,15	23.440	335	70,05	24.756	361	68,50
Klasse A USD Ausschüttend (M)	2.587	30	86,05	1.440	17	84,80	1.248	15	82,95
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	6.127	91	67,06	2.238	33	68,57	1.669	24	68,90
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1.438	18	66,83	1.241	18	67,29	1.385	19	66,93
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	229	18	99,02	153	12	100,90	–	–	102,01
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	8.121	17.101	0,60	2.934	6.289	0,63	583	1.216	0,65
Klasse C USD Thesaurierend	4.474	21	215,88	4.004	20	200,86	4.321	24	183,63
Klasse C USD Ausschüttend (D)	2.622	37	71,16	2.426	35	70,06	1.778	26	68,50
Klasse E USD Thesaurierend	2.471	12	202,90	2.304	12	189,08	2.662	15	173,13
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1.272	14	88,92	416	5	87,51	402	5	85,57
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	152	1	111,87	113	1	106,53	375	3	99,26
Klasse F USD Thesaurierend	3.415	16	214,45	3.189	16	197,86	3.121	17	179,36
Klasse F USD Ausschüttend (D)	141	2	84,64	134	2	83,33	179	2	81,52

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:
FTGF Western Asset US High Yield Fund (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD Thesaurierend	\$ 10.400	46	225,12	\$ 16.680	81	207,10	\$ 20.612	110	187,18
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	2	–	133,39	1	–	122,92	4	–	111,24
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	1	–	92,78	1	–	91,40	1	–	89,40
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	85,27	1	–	85,88	30	–	85,40
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	–	–	–	7.451	96	77,58	15.675	207	75,89
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	32	–	137,36	12	–	126,08	11	–	113,75
Klasse A (G) USD Thesaurierend	99	–	235,55	208	1	218,32	204	1	198,80
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	891	13	70,59	1.059	15	69,49	1.051	15	67,96
Klasse L (G) USD Thesaurierend	182	1	214,32	169	1	199,63	155	1	182,70
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	402	6	70,57	472	7	69,47	644	9	67,95
Klasse GF USD Thesaurierend	128	1	211,42	119	1	195,46	116	1	177,55
FTGF Western Asset Global High Yield Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 5.403	26	209,52	\$ 6.460	33	192,87	\$ 5.296	30	176,21
Klasse A USD Ausschüttend (D)	5.083	76	67,11	5.792	88	65,52	5.988	94	63,78
Klasse A USD Ausschüttend (M)	6.575	88	74,46	6.324	87	72,75	7.148	101	70,83
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	3.287	53	61,69	4.014	64	62,33	4.468	72	62,40
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	3.343	68	69,16	3.474	80	70,37	4.216	91	71,08
Klasse A EUR Thesaurierend	1.283	9	126,36	1.808	13	132,51	1.840	15	116,18
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	30	–	63,31	26	–	63,19	121	2	62,53
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	2.913	6.601	0,56	1.380	3.222	0,58	1.739	3.966	0,59
Klasse B USD Ausschüttend (D)	–	–	–	–	–	–	30	–	63,65
Klasse C USD Thesaurierend	695	4	195,63	844	5	180,99	916	6	166,18
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1.708	26	66,82	1.735	27	65,23	1.760	28	63,49
Klasse E USD Thesaurierend	301	2	177,57	606	4	164,73	749	5	151,67
Klasse E USD Ausschüttend (D)	159	2	82,27	161	2	80,32	166	2	78,18
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	88	1	62,95	77	1	62,84	52	1	62,22
Klasse F USD Thesaurierend	3.316	17	190,72	1.958	11	175,17	1.612	10	159,68
Klasse F USD Ausschüttend (D)	454	6	78,08	433	6	76,32	488	7	74,20
Klasse X USD Ausschüttend (D)	526	6	87,48	1.294	15	85,41	3.619	44	83,18
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	392	4	69,40	617	7	67,93	3.630	43	66,28
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	717	4	139,00	760	6	130,11	1.491	11	120,34
Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	32	–	75,45	29	–	73,84	28	–	72,07
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	1	–	95,49	1	–	93,26	1	–	90,78
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	87,71	1	–	87,52	30	–	86,67
Klasse A (G) USD Thesaurierend	752	4	211,30	1.200	6	195,14	1.146	6	178,87
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	694	10	67,11	842	13	65,52	896	14	63,77
Klasse L (G) USD Thesaurierend	456	2	192,28	423	2	178,46	459	3	164,40
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	550	8	67,12	530	8	65,52	630	10	63,79
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 17.186	101	170,33	\$ 20.126	127	158,84	\$ 25.581	167	153,39
Klasse A USD Ausschüttend (D)	6.193	61	101,96	4.705	48	97,37	4.953	51	96,59
Klasse A USD Ausschüttend (M)	3.210	34	93,99	3.471	39	89,76	4.606	52	89,07
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	17.444	270	64,54	21.876	346	63,25	25.435	395	64,36
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	7.408	149	69,63	8.285	194	68,65	11.147	243	70,51
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	15	–	85,36	16	–	86,13
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	11.948	1.262	64,94	28.565	3.186	65,41	23.093	2.436	68,32
Klasse A EUR Thesaurierend	587	2	227,17	527	4	241,32	1.377	6	223,59
Klasse A EUR Ausschüttend (Abgesichert)	293	2	103,15	479	5	98,42	859	8	96,76
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	59	–	103,42	77	1	112,79	361	3	107,52
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	3.707	372	77,86	4.850	497	75,83	5.412	546	77,67
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	391	333	1,49	608	578	1,42	591	568	1,40
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.592	3.194	0,63	1.117	2.379	0,63	1.441	2.946	0,66
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	173	330	0,66	170	332	0,69	396	759	0,70
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	58	–	152,25	56	–	147,41
Klasse C USD Thesaurierend	799	5	155,46	860	6	145,69	1.253	9	141,40
Klasse C USD Ausschüttend (D)	260	3	101,95	558	6	97,38	800	8	96,60
Klasse E USD Thesaurierend	216	2	133,67	311	2	125,40	483	4	121,83
Klasse E USD Ausschüttend (D)	203	2	93,73	191	2	89,51	185	2	88,79
Klasse F USD Thesaurierend	918	6	158,00	914	6	146,75	1.082	8	141,15
Klasse F USD Ausschüttend (D)	631	7	93,78	731	8	89,57	708	8	88,85
Klasse X USD Ausschüttend (M)	2.057	23	90,37	966	11	86,30	1.117	13	85,64
Klasse Premier USD Thesaurierend	16.930	89	190,63	47.899	271	176,62	55.334	327	169,46
Klasse Premier EUR Thesaurierend	2.427	13	161,81	2.261	13	170,76	29.793	175	157,55
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	2.985	26	112,18	3.732	32	109,56
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	16.833	156	91,42	16.118	156	99,71	21.356	208	95,08
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	11.548	102	96,20	11.028	102	104,64	10.943	102	99,65
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)	45	–	104,88	44	–	107,30	74	1	106,10
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	12.765	66	193,43	15.379	83	184,48
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	–	–	–	–	–	–	1.769	20	89,58
Klasse LM EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.296	15	82,67
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 29.332	209	140,54	\$ 29.867	223	134,17	\$ 32.186	253	126,97
Klasse A USD Ausschüttend (M)	10.040	90	112,02	10.599	97	108,80	10.728	102	104,94
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2.214	19	98,66	5.602	56	96,31	15.241	152	92,69
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	3.827	349	98,92	5.787	644	96,72	10.828	1.203	93,27
Klasse A SEK Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1	–	91,29
Klasse C USD Thesaurierend	2.635	20	129,30	3.028	24	124,06	3.635	31	118,00
Klasse C USD Ausschüttend (M)	–	–	–	117	1	107,60	3.832	37	103,78
Klasse E USD Thesaurierend	2.167	18	121,35	2.246	19	116,56	3.167	29	110,97
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1.139	11	106,25	1.175	11	103,19	1.163	12	99,53
Klasse F USD Thesaurierend	1.369	10	143,01	1.238	9	135,99	3.036	24	128,18
Klasse F USD Ausschüttend (D)	–	–	101,30	–	–	99,12	215	2	95,81
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	101,06	344	3	98,06	20.039	197	93,97
Klasse Premier USD Thesaurierend	29.421	187	157,53	10.740	72	149,39	13.167	94	140,44
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	5.097	40	97,97	4.402	40	99,36	4.697	42	100,08
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	35	–	106,78	31	–	103,53	12.290	115	98,95
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	250	2	100,95
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	141	1	146,34	139	1	139,04	191	1	130,91
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	105,02	2	–	102,17	61	–	98,73
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	28.759	274	104,92	27.457	268	102,32	56.466	570	99,06
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	103,03	–	–	99,71	28	–	95,09
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	4.971	47	88,84	4.685	51	88,51	12.489	133	87,18
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	60.978	460	98,33	71.203	589	96,05	274.828	2.336	93,18
FTGF Western Asset Global Bond Fund**									
Klasse A USD Ausschüttend (A)	\$ 1	–	96,88	\$ 1	–	94,81	\$ 17	–	93,66
Klasse X USD Thesaurierend	32	–	119,13	1.277	11	113,35	1.341	12	109,21
Klasse Premier USD Thesaurierend	19.594	121	162,49	24.802	161	154,41	25.994	175	148,60
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	255	2	105,43	224	2	102,34	22.399	207	100,29
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2	–	89,82
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.447	40	99,96
Klasse P1 USD Thesaurierend	1	–	106,44	1	–	100,84	1	–	96,73
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	97,76	1	–	94,73	29	–	92,43
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3.823	36	104,98
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	78.140	927	114,93	71.025	927	110,80	73.367	927	107,37
FTGF Western Asset Global Credit Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 228	2	149,05	\$ 267	2	141,17	\$ 795	6	132,56
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	44	–	120,22	79	1	116,42	252	2	111,18
Klasse X USD Thesaurierend	1	–	119,17	1	–	112,61	1	–	105,17
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	28	–	85,21

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:	Gesamt-NIW (in Tsd.)	Anz. Anteil (in Tsd.)	NIW/ Anteil:
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^] (Fortsetzung)									
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 20	–	87,90
Klasse LM USD Thesaurierend	10.156	55	183,38	21.840	127	172,19	25.451	159	160,20
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	4.939	53	90,01	4.450	48	85,20
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 255.880	1.992	128,45
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	101.377	1.328	76,32
Klasse A USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	23.243	253	91,73
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.502	25	91,98
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	12.151	259	72,26
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	3.865	35	99,03
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	930	51	132,11
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1.593	134	85,47
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	185.605	1.629	105,43
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	4.081	41	91,30
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	4.234	56	69,55
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	5.823	68	79,62
Klasse A GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	161	1	146,50
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	3.722	26	113,84
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	7.149	82	69,25
Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	253	4	10.003,12
Klasse A NOK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	4.442	532	88,61
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	976	105	96,33
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	6.917	7.805	1,19
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	17.973	33.238	0,73
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	29	50	0,78
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	30.958	271	114,30
Klasse C USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	3.922	43	90,81
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	10.586	94	112,53
Klasse E USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	983	11	90,58
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.521	25	93,47
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	34.838	283	123,31
Klasse F USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	3.090	33	92,91
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	57.086	436	130,98
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	3.014	37	81,50
Klasse X USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	7.914	87	91,41
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	8.388	72	103,23
Klasse X EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.899	11	153,88
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	51.069	426	110,90
Klasse X EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	3.136	38	76,87
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	522	6	76,16
Klasse X GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	911	5	153,58
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	23.562	155	120,69
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	1.358	14	74,59
Klasse X SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.243	2.410	1,25
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	46.954	342	137,29
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	14.313	157	91,20
Klasse Premier AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	836	13	98,05
Klasse Premier AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	983	17	86,86
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	28.142	794	176,12
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	3.432	31	98,95
Klasse Premier CHF Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.106	13	74,48
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	14.867	86	160,49
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	93.921	794	109,45
Klasse Premier EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	27.388	322	78,39
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	4.217	29	113,89
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	17.316	187	73,20
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	46.942	712	9.886,79
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	1.945	74	104,43
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	27	3	101,75
Klasse P2 USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	11	–	143,01
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	2.596	20	119,87
Klasse LM AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	9.507	176	82,92
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	640	4	140,26
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 24	–	112,63
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1	–	74,90	1	–	75,64	41	1	76,66
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	6	–	104,45	5	–	100,92	26	–	96,32
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1	–	111,66
Klasse X CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	40	1	67,31
Klasse P2 USD Thesaurierend	–	–	–	1.231	12	106,08	1.397	14	98,47
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	19.258	200	74,03	19.399	200	87,58	19.394	200	85,76
Klasse P2 CHF Ausschüttend (S) (Abgesichert)	4.603	40	88,49	4.133	40	93,30	4.410	40	97,52
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.304	97	107,63	19.322	181	102,90	17.967	171	97,16
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	63.610	406	116,21	49.325	360	108,94	39.226	306	101,40
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)	24.696	372	10.367,21	24.944	372	10.093,89	–	–	–
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	19.356	236	111,92	16.975	231	106,24	17.064	233	99,28
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	35.543	327	104,85	42.308	397	98,62
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	193.803	993	144,76	236.145	1.389	135,19	230.783	1.459	125,34
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]									
Klasse D USD Thesaurierend	\$ 241	2	124,19	\$ 805	7	118,15	\$ 1.564	14	107,97
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1.056	14	77,67	1.073	14	78,94	737	9	78,16
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	211	3	71,98
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.192	10	104,86	1.017	10	101,94	994	10	94,69
Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	87	1	100,53	73	1	99,30	71	1	94,12
Klasse M USD Ausschüttend (M)	932	12	77,36	881	11	78,62	800	10	77,85
Klasse M EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	54	1	99,37
Klasse Premier USD Thesaurierend	5.292	33	161,32	18.728	123	152,31	72.263	523	138,14
Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)	–	–	–	4.619	57	80,67	8.801	110	80,01
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	211	1	133,68	178	1	128,98	576	4	118,91
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	161	2	67,77	147	2	70,33	154	2	70,91
Klasse LM USD Thesaurierend	519.608	3.021	172,00	487.681	3.021	161,43	439.931	3.023	145,54
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 10	–	76,41	\$ 9	–	74,48	\$ 9	–	73,19
Klasse Premier USD Thesaurierend	70.903	620	114,36	58.146	545	106,69	61.613	615	100,18
Klasse LM USD Thesaurierend	1.174.143	9.984	117,60	1.162.232	10.625	109,38	1.088.086	10.625	102,41
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]									
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	\$ 18.572	256	72,50	\$ 18.317	257	71,28	\$ 18.396	254	72,41
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 5.530	43	127,88	\$ 5.979	49	123,11	\$ 7.846	64	122,99
Klasse A USD Ausschüttend (M)	456	6	70,28	697	10	69,64	753	10	72,35
Klasse A USD Ausschüttend (S)	5.548	64	86,73	6.321	74	85,98	14.513	162	89,80
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	134	4	48,08	384	13	48,89	488	5	52,13
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	6.360	80	67,40	8.281	120	66,32	567	8	67,44
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	13.441	96	130,11
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	53	1	50,97	91	2	52,24	117	2	55,76
Klasse A EUR Ausschüttend (S)	34	–	65,27	35	–	73,70	37	–	73,87
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	3.615	31	98,80	3.924	38	100,08	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	4.861	54	82,53
Klasse A GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	87	1	87,90

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (Fortsetzung)									
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	\$ 74	1	57,34	\$ 77	1	56,94	\$ 86	1	59,42
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1.938	14	101,80	2.089	16	101,11	–	–	–
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	2.649	23	92,67
Klasse A SGD Thesaurierend	9	13	0,82	14	23	0,84	63	101	0,84
Klasse B USD Thesaurierend	7	–	114,98	7	–	110,99	7	–	111,16
Klasse B USD Ausschüttend (S)	–	–	–	–	–	–	44	–	89,76
Klasse C USD Thesaurierend	199	2	109,89	297	3	106,36	298	3	106,78
Klasse C USD Ausschüttend (S)	666	8	86,35	725	8	85,61	750	8	89,40
Klasse E USD Thesaurierend	269	3	83,57	325	4	80,96	654	8	81,37
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	429	4	101,51	378	4	100,45	–	–	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	431	4	91,65
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	7.353	83	88,50	174	2	88,07
Klasse F USD Ausschüttend (S)	–	–	–	73	1	63,44	76	1	66,24
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	3	–	102,12	8	–	101,37	–	–	–
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	21	–	76,53
Klasse X USD Thesaurierend	96	1	92,95	55	1	89,02	2.374	27	88,48
Klasse X USD Ausschüttend (S)	37	1	64,29	35	1	63,74	35	1	66,56
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	3.613	41	74,86	120	2	73,32	29	–	74,20
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	732	8	89,19
Klasse X GBP Thesaurierend	3.217	23	105,39	5.875	43	108,20	12.765	94	107,21
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1.292	12	80,11	2.068	21	76,88	4.296	44	76,77
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	114	1	95,81
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	6.295	82	56,74	7.270	103	56,37	5.847	78	59,06
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	3.828	39	78,16
Klasse Premier USD Thesaurierend	1.574	14	108,59	2.031	20	103,86	21.414	208	103,09
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	–	–	66,42	14	–	65,77	24	–	68,68
Klasse Premier EUR Thesaurierend	44	–	125,82	1.279	9	137,10	2.300	16	130,58
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	992	11	73,06	1.262	17	71,41	1.245	16	72,28
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	6.583	54	112,34
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	82,20	1	–	78,71	3	–	78,49
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	46	1	56,91	44	1	56,44	54	1	58,87
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	54	–	102,24	102	1	101,53	–	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	345	3	84,20
Klasse LM USD Thesaurierend	4.026	42	94,80	3.940	44	90,29	2.860	32	89,08
Klasse LM USD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	32.588	290	112,52
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 658	5	130,10	\$ 595	5	119,54	\$ 599	5	116,57
Klasse A USD Ausschüttend (A)	162	2	90,87	149	2	88,17	145	2	90,30
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	17	–	96,63	102	1	90,86	157	2	90,29
Klasse A SGD Thesaurierend	–	–	–	2	2	1,02	1	2	0,99
Klasse C USD Thesaurierend	305	3	111,03	344	3	102,53	367	4	100,48
Klasse E USD Ausschüttend (A)	22	–	91,97	21	–	89,22	22	–	91,37
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	28	–	108,20
Klasse X USD Thesaurierend	194	2	112,66	177	2	102,96	172	2	99,91
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	42	–	112,35	2.709	21	102,85	2.640	21	100,18
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	116	1	78,85	49	1	76,75	86	1	79,19
Klasse Premier USD Thesaurierend	39.073	307	127,39	121.878	1.048	116,35	121.526	1.078	112,78
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	307	2	112,51	2.505	23	105,19	3.047	27	103,85
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	–	–	–	7	–	74,46	12.202	126	76,87
Klasse LM USD Thesaurierend	6.069	44	139,05	5.494	44	125,87	5.277	44	120,91
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 27.443	187	147,13	\$ 6.388	46	140,38	\$ 2.744	21	128,99
Klasse A USD Ausschüttend (D)	10.099	117	86,01	7.161	82	87,09	1.384	16	85,59
Klasse F USD Thesaurierend	40	–	112,61	38	–	106,91	–	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (D)	2.423	24	100,90	1.593	16	102,16	75	1	100,28
Klasse Premier USD Thesaurierend	7	–	185,97	6	–	176,31	6.557	41	160,88
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	–	–	–	87	–	173,71	80	–	157,47
Klasse P2 USD Thesaurierend	1.091	10	109,19	1.056	10	103,23	–	–	–
Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	19.422	155	171,45	17.986	155	168,40	11.283	100	153,44
Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	9.307	73	108,00	8.772	74	115,03	9.041	74	113,79
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1.498	13	113,98	\$ 1.060	10	102,02	\$ 2.826	27	105,16
Klasse A USD Ausschüttend (M)	258	3	84,36	227	3	79,00	512	6	85,59
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	5	–	69,92	6	–	73,54
Klasse A SGD Thesaurierend	–	3	0,90	12	20	0,86	–	21	0,88
Klasse C USD Thesaurierend	108	1	102,26	97	1	92,01	131	1	95,33
Klasse E USD Thesaurierend	291	3	99,77	580	6	89,85	290	3	93,18
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	6	–	102,51	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	575	6	100,98	563	6	90,04	1.967	21	92,45
Klasse F USD Ausschüttend (M)	333	5	72,31	312	5	67,72	220	3	73,37
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	351	4	62,47	39	1	58,74	39	–	64,06
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	808	7	87,03
Klasse Premier USD Thesaurierend	179.871	1.459	123,27	163.343	1.490	109,65	183.751	1.636	112,30
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)	–	–	–	–	–	–	1.816	17	83,14
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	5.986	62	160,94	5.225	62	150,57	5.709	62	151,23
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.621	14	109,57
Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	9.948	86	193,15	8.042	80	179,55	7.666	70	179,20
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 89.029	586	152,03	\$ 148.178	1.044	141,99	\$ 186.183	1.370	135,93
Klasse A USD Ausschüttend (A)	591	7	87,93	610	7	87,29	1.619	18	87,86
Klasse A USD Ausschüttend (D)	13.370	161	82,85	12.539	152	82,30	16.750	200	83,74
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	22.447	302	74,42	21.985	290	75,82	28.773	369	78,01
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	48.931	623	78,57	69.769	880	79,27	86.736	1.061	81,76
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	3.271	48	96,53	2.713	48	90,78	2.883	51	87,60
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	803	16	71,79	863	19	73,78	1.471	30	76,50
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	979	99	67,53	1.649	170	70,76	1.260	121	74,73
Klasse A CZK Thesaurierend (Abgesichert)	961	17	1.151,29	480	11	1.087,72	35	1	1.048,15
Klasse A EUR Thesaurierend	3	–	105,21	2	–	111,87	–	–	102,70
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	15.096	119	107,40	27.557	259	102,56	44.018	408	99,82
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	18.377	196	79,28	19.905	238	80,71	26.885	301	82,59
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)	1	–	104,82	1	–	102,14	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	97,47	1	–	102,14	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.716	21	68,58	1.334	18	71,41	1.975	24	74,76
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	22.936	306	63,36	24.857	367	65,32	30.592	413	68,53
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	2.131	22	73,09	1.411	15	74,70	2.024	21	77,11
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	3.416	35	71,60	4.033	44	72,46	6.130	65	74,94
Klasse A HKD Thesaurierend	605	47	101,06	637	53	93,84	653	56	90,45
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	5.585	582	75,05	6.579	673	76,03	8.043	800	78,76
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	20.101	33.493	0,76	23.886	40.666	0,79	33.994	54.979	0,83
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20.007	35.921	0,70	20.913	38.744	0,73	23.558	41.347	0,77
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	2.005	3.578	0,71	2.101	3.679	0,77	3.324	5.658	0,79
Klasse C USD Thesaurierend	6.640	64	104,17	8.408	86	97,78	16.481	175	94,08
Klasse C USD Ausschüttend (D)	9.228	113	81,38	11.248	139	80,84	11.912	145	82,24
Klasse E USD Thesaurierend	12.520	111	112,47	20.161	191	105,67	35.624	350	101,77
Klasse E USD Ausschüttend (D)	296	4	81,14	778	10	80,63	836	10	82,02
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	4.301	36	101,65	4.856	48	97,73	5.546	54	95,83
Klasse F USD Thesaurierend	11.397	104	109,15	14.166	140	101,48	20.610	213	96,71
Klasse F USD Ausschüttend (D)	1.882	21	90,45	3.238	36	89,86	5.158	56	91,43
Klasse X USD Thesaurierend	8.474	76	111,18	6.129	59	103,17	4.666	48	98,12
Klasse X USD Ausschüttend (D)	1	–	90,55	1	–	89,96	1	–	91,51

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (Fortsetzung)									
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ 11.550	138	83,95	\$ 13.592	162	84,16	\$ 14.868	172	86,24
Klasse X EUR Thesaurierend	2.207	17	107,26	1.222	10	113,35	1.012	9	103,52
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	920	8	94,95	794	8	90,14	8.687	92	87,36
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	98,46	1	–	102,23	–	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1.489	19	67,95	1.889	26	69,58	12.324	157	72,59
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1.194	12	76,96	1.659	17	77,35	2.973	30	79,52
Klasse Premier USD Thesaurierend	45.588	412	110,58	87.347	852	102,46	86.074	885	97,30
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	7.829	91	86,31	8.002	93	86,39	15.699	178	88,40
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	156	7	107,56
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	27.248	188	122,86	42.958	356	116,45	69.864	574	112,55
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	98,46	1	–	102,23	–	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20.776	254	69,25	18.420	250	70,99	42.042	527	73,85
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	339	3	80,35
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	3.025	222	122,76	2.372	219	116,56	2.473	227	112,78
Klasse P2 USD Thesaurierend	166.275	1.446	114,98	88.123	828	106,43	87.617	868	100,97
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	2.096	26	80,17	2.099	26	80,31	74	1	81,85
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	10.508	78	114,16	8.835	79	107,97	38.772	344	104,20
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	3.453	37	78,57	3.485	42	80,38	4.483	50	83,51
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	137	1	81,12	51	1	81,19	75	1	83,23
Klasse LM USD Thesaurierend	18.239	149	122,06	16.824	149	112,59	15.905	149	106,44
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	6.594	81	81,79	5.850	72	81,38	4.097	49	82,79
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	22.848	230	99,52	8.147	82	99,12	1	–	100,36
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1	–	100,05	1	–	102,28	–	–	–
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	36.860	420	74,35	131.628	1.670	75,99	113.322	1.337	78,43
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	578	4	110,12	10.796	84	101,90	22.781	187	96,55
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 2.080	17	122,48	\$ 371	3	112,79
Klasse X USD Ausschüttend (M)	–	–	–	–	1	90,85	–	–	90,21
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	8.816	67	131,29	12.037	100	120,11
Klasse LM USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	3.994	30	133,95
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 29	–	86,87
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	75	120	0,84
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	4	–	60,49
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	70.929	1.223	89,24
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 101	1	96,21
Klasse P1 USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	15.597	148	105,56
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	105	1	94,75
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	26	–	103,03
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1	–	116,10	\$ 1	–	110,53	\$ 1	–	105,44
Klasse P1 USD Thesaurierend	35.277	300	117,59	36.816	331	111,24	31.698	300	105,66
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1	–	124,59	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse X USD Thesaurierend	1	–	125,33	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	1	–	125,79	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	120,61	–	–	–	–	–	–
Klasse LM NZD Thesaurierend	69.398	958	120,70	–	–	–	–	–	–
FTGF ClearBridge US Value Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 87.821	366	240,10	\$ 118.178	561	210,81	\$ 121.992	663	183,96
Klasse A USD Ausschüttend (A)	33.485	73	456,17	35.028	87	400,53	31.475	90	349,52
Klasse A EUR Thesaurierend	20.169	66	257,10	24.588	92	257,03	20.509	88	215,29
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.044	6	147,98	1.338	10	132,41	513	4	117,54
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	32	–	208,20	26	–	186,21	47	–	165,46
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	135	–	318,93	78	–	299,96	25	–	260,70
Klasse A SGD Thesaurierend	3.319	2.230	1,88	6.070	4.642	1,77	5.626	4.930	1,54
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1.472	522	3,57	1.574	661	3,22	1.569	737	2,86
Klasse C USD Thesaurierend	14.895	63	238,28	14.249	68	210,26	9.640	52	184,40
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2.754	7	405,56	2.882	8	357,87	2.951	9	313,86
Klasse E USD Thesaurierend	3.371	23	149,34	7.432	56	132,11	3.173	27	116,15
Klasse F USD Thesaurierend	28.047	58	487,59	34.378	81	425,57	27.705	75	369,14
Klasse F USD Ausschüttend (A)	462	2	266,96	403	2	233,54	367	2	203,38
Klasse X USD Thesaurierend	3.250	20	159,56	3.640	26	138,91	1.773	15	120,27
Klasse X USD Ausschüttend (A)	4.371	13	334,71	9.519	33	292,59	3.786	15	254,51
Klasse X EUR Thesaurierend	11.510	57	172,39	220.644	1.244	170,94	5.778	38	142,09
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	111,47	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	107.670	240	448,66	399.930	1.026	389,93	582.482	1.730	336,79
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	208	1	298,86	243	1	261,42	75	–	227,57
Klasse Premier EUR Thesaurierend	59.906	146	348,37	134.268	375	344,87	116.174	376	286,04
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	17.137	101	143,66	57.944	439	127,30	110.865	917	111,92
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	129,55	1	–	120,42	1	–	103,51
Klasse S USD Thesaurierend	211.227	1.464	144,28	133.993	1.070	125,21	102.451	949	107,98
Klasse S GBP Thesaurierend	3.328	24	102,59	–	–	–	–	–	–
LM Klasse USD Ausschüttend (A)	7.290	47	155,11	8.963	66	135,65	8.649	73	118,00
FTGF Putnam US Research Fund[*]									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 51.037	105	485,55	\$ 38.644	95	408,84	\$ 37.093	104	358,09
Klasse A USD Ausschüttend (A)	5.129	11	485,19	4.889	12	408,54	9.624	27	357,83
Klasse A EUR Thesaurierend	10.347	15	601,85	1.808	3	577,58	2.958	6	485,31
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.204	8	125,15	–	–	–	–	–	–
Klasse A HKD Thesaurierend	1	–	128,13	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,24	–	–	–	–	–	–
Klasse AX AUD Thesaurierend (Abgesichert)	124	1	127,11	–	–	–	–	–	–
Klasse AX CHF Thesaurierend (Abgesichert)	46	–	123,61	–	–	–	–	–	–
Klasse AX EUR Thesaurierend (Abgesichert)	530	4	125,93	–	–	–	–	–	–
Klasse AX GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	127,88	–	–	–	–	–	–
Klasse AX HKD Thesaurierend	1	–	129,05	–	–	–	–	–	–
Klasse AX SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,25	–	–	–	–	–	–
Klasse AX USD Thesaurierend	1.844	14	128,11	–	–	–	–	–	–
Klasse B USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	26	–	321,46
Klasse B USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	42	–	120,88
Klasse C USD Thesaurierend	19.579	45	431,41	17.119	47	365,41	15.586	48	321,41
Klasse C USD Ausschüttend (A)	24.211	55	441,71	22.952	61	374,14	21.370	65	329,09
Klasse D1 HKD Thesaurierend	1	1	1,25	–	–	–	–	–	–
Klasse D1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	1,25	–	–	–	–	–	–
Klasse D1 USD Thesaurierend	37.147	290	128,09	–	–	–	–	–	–
Klasse D2 HKD Thesaurierend	1	–	128,95	–	–	–	–	–	–
Klasse D2 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,25	–	–	–	–	–	–
Klasse D2 USD Thesaurierend	3.578	28	127,82	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	22.096	45	496,54	19.169	45	421,63	18.472	50	371,80
Klasse E USD Ausschüttend (A)	1.526	3	496,71	1.296	3	421,78	1.260	3	371,92
Klasse F USD Thesaurierend	24.188	52	463,94	20.023	51	389,07	20.011	59	338,74
Klasse F USD Ausschüttend (A)	4.727	8	615,41	4.004	8	516,10	4.897	11	449,51
Klasse X USD Thesaurierend	1	–	128,13	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1.896	5	400,34	1.597	5	334,30	1.390	5	290,70
Klasse X EUR Thesaurierend	4.009	7	472,38	18	–	449,29	16	–	374,84
Klasse X GBP Thesaurierend	26	–	127,36	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	50.570	78	647,84	7.226	13	540,60	4.935	11	468,91

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	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 Putnam US Research Fund* (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	\$ 1.814	2	748,11	\$ 1.985	3	625,26	\$ 1.968	4	544,32
Klasse Premier EUR Thesaurierend	86.765	107	688,66	1.841	3	653,22	29.057	49	544,06
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	127,68	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,26	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	1	–	128,57	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend	1	–	123,81	–	–	–	–	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	126,33	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP Thesaurierend	1	–	128,11	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 USD Thesaurierend	434.578	3.378	128,64	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 AUD Thesaurierend (Abgesichert)	2	–	127,68	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	1.445	9	124,36	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.159	142	126,54	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	9.470	55	128,44	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 HKD Thesaurierend	1	–	129,62	–	–	–	–	–	–
Klasse P1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,26	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	264.878	2.060	128,61	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	124,16	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend	202.898	1.388	123,69	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	135.081	904	126,51	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend	9.758	57	128,03	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend	24.559	68	362,99	24.242	80	301,39	27.678	107	259,79
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	1.253	4	273,25
Klasse A (G) USD Thesaurierend	4.687	9	514,59	4.247	10	432,63	4.270	11	377,61
Klasse B (G) USD Thesaurierend	7	–	467,26	6	–	394,81	5	–	346,32
Klasse L (G) USD Thesaurierend	4.328	9	468,36	3.737	9	395,73	3.284	9	347,14
Klasse GA USD Thesaurierend	6.114	12	513,38	5.672	13	432,34	5.124	14	378,01
Klasse GA EUR Thesaurierend	565	1	624,77	485	1	599,31	426	1	502,92
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	731	1	622,91	633	1	597,52	563	1	501,43
Klasse GE USD Thesaurierend	186	–	459,76	157	–	390,09	139	–	343,64
Klasse GE EUR Thesaurierend	12	–	559,00	10	–	540,29	9	–	456,83
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 254.609	414	615,03	\$ 293.114	486	603,37	\$ 291.603	544	535,90
Klasse A USD Ausschüttend (A)	42.435	69	615,31	44.550	74	603,65	42.700	80	536,15
Klasse A EUR Thesaurierend	73.623	75	835,99	93.206	96	934,50	86.759	101	796,62
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	13.562	39	292,23	19.381	64	291,75	18.990	67	263,79
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1	–	124,26	1	–	138,97	1	–	118,33
Klasse B USD Thesaurierend	6	–	551,66	6	–	543,86	6	–	485,30
Klasse B USD Ausschüttend (A)	31	–	559,84	61	–	551,97	59	–	492,71
Klasse C USD Thesaurierend	25.936	47	551,60	27.408	50	543,85	27.399	56	485,46
Klasse C USD Ausschüttend (A)	8.975	16	559,94	11.686	21	552,07	12.261	25	492,80
Klasse E USD Thesaurierend	7.391	23	324,14	12.306	38	320,39	11.555	40	286,71
Klasse E USD Ausschüttend (A)	8	–	314,34	22	–	310,74	43	–	278,07
Klasse F USD Thesaurierend	46.797	137	342,47	107.866	323	333,98	98.806	335	294,85
Klasse F USD Ausschüttend (A)	16.533	48	341,75	19.052	57	333,27	18.482	63	294,22
Klasse X USD Thesaurierend	20.379	53	384,05	29.134	78	374,22	44.931	136	330,19
Klasse X EUR Thesaurierend	1.961	7	254,05	7.045	24	282,13	5.031	19	238,85
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	3.371	11	270,55	3.390	12	268,33	9.787	38	240,87
Klasse X GBP Thesaurierend	5.149	10	382,14	10.557	21	399,31	14.261	32	351,17
Klasse Premier USD Thesaurierend	180.869	441	409,92	364.815	916	398,26	404.984	1.156	350,29
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	8.066	42	193,44	8.020	43	187,94	7.033	43	165,30
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	50.800	765	340,49	43.966	840	308,20	30.321	576	261,50
Klasse Premier EUR Thesaurierend	77.748	201	326,60	114.692	306	361,70	111.362	337	305,37
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.374	4	304,62	78.620	251	301,57	62.598	215	269,94
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	5.245	25	176,96	5.905	29	195,94	6.968	39	165,57
Klasse Premier GBP Thesaurierend	104.523	198	392,33	108.317	211	408,40	116.480	258	358,00
Klasse S USD Thesaurierend	297.773	1.133	262,89	268.463	1.052	255,16	239.721	1.069	224,20
Klasse S USD Ausschüttend (Q)	24.646	186	132,38	26.878	209	128,49	9.379	83	112,91
Klasse S EUR Thesaurierend	42.700	132	273,58	201.271	641	302,62	112.184	407	255,24
Klasse LM USD Thesaurierend	58.929	152	388,55	70.694	188	375,15	61.484	188	327,89
Klasse LM EUR Thesaurierend	988	8	99,74	2.362	21	109,66	389	1	345,23
Klasse A (G) USD Thesaurierend	9.986	15	651,76	11.355	18	637,18	10.921	19	563,95
Klasse L (G) USD Thesaurierend	14.329	24	593,13	14.557	25	582,76	14.076	27	518,37
Klasse GA USD Thesaurierend	783	1	767,23	1.253	2	751,35	2.001	3	666,12
Klasse GA EUR Thesaurierend	28	–	828,45	28	–	924,14	25	–	786,38
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund**									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 52.949	196	270,16	\$ 59.251	238	248,53
Klasse A USD Ausschüttend (A)	–	–	–	12.819	47	270,33	17.024	68	248,68
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	3.196	27	191,83	3.724	32	179,11
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	63	–	125,08	61	–	119,89
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	575	24	172,04	836	37	162,31
Klasse A EUR Thesaurierend	–	–	–	7.612	17	420,18	7.945	20	371,22
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	579	3	176,33	673	4	165,29
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	14	–	115,57
Klasse A GBP Thesaurierend	–	–	–	84	–	203,02	145	1	186,23
Klasse A HKD Thesaurierend	–	–	–	197	10	161,59	175	9	149,72
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	26	2	181,49	29	2	170,64
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.224	781	2,12	5.173	3.506	1,99
Klasse B USD Ausschüttend (A)	–	–	–	5	–	247,14	4	–	228,52
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	5.939	23	257,85	6.422	27	238,39
Klasse C USD Ausschüttend (A)	–	–	–	8.649	35	247,16	9.010	39	228,51
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	4.297	17	253,89	4.964	21	235,38
Klasse E USD Ausschüttend (A)	–	–	–	754	3	253,93	718	3	235,42
Klasse E EUR Thesaurierend	–	–	–	11	–	104,05	10	–	92,58
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	24	–	145,51	123	1	137,46
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	7.812	25	307,67	8.560	30	281,40
Klasse F USD Ausschüttend (A)	–	–	–	933	3	307,88	512	2	281,60
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	3.282	15	221,37	3.127	15	202,12
Klasse X USD Ausschüttend (A)	–	–	–	696	3	246,05	679	3	224,65
Klasse X EUR Thesaurierend	–	–	–	138	1	244,65	308	1	214,49
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	39	–	150,22	58	–	139,71
Klasse X GBP Thesaurierend	–	–	–	9.861	28	281,16	10.838	34	255,87
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	4.418	12	372,02	4.629	14	338,89
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	2.792	6	419,60	2.437	6	366,91
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	90	1	120,14
Klasse Premier GBP Thesaurierend	–	–	–	242	1	155,76	265	1	141,42
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	178	1	166,69	243	1	152,46
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	–	–	–	25.952	59	351,41	35.296	88	319,10
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	340	2	193,95
Klasse A (G) USD Thesaurierend	–	–	–	15.613	54	286,59	16.350	62	262,78
Klasse B (G) USD Thesaurierend	–	–	–	8	–	262,18	7	–	241,66
Klasse L (G) USD Thesaurierend	–	–	–	5.395	21	262,10	7.012	29	241,53
Klasse GA EUR Thesaurierend	–	–	–	168	–	445,73	155	–	392,74
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	–	–	–	76	–	444,06	70	–	391,27
Klasse GE USD Thesaurierend	–	–	–	78	–	325,53	72	–	301,10
Klasse GE EUR Thesaurierend	–	–	–	45	–	401,48	41	–	356,43
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund*									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 15.550	78	200,63	\$ 15.090	82	184,95	\$ 12.725	79	160,24
Klasse A USD Ausschüttend (A)	194	1	151,87	113	1	140,62	99	1	122,86
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1.605	16	102,92	1.959	20	98,74	1.499	17	89,07
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	2	–	130,85	–	–	123,31	–	–	109,31
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1.525	10	150,90	1.436	10	139,74	1.251	10	121,80

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:	Gesamt-NI/W (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NI/W/ Anteil:
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund* (Fortsetzung)									
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	\$ 603	9	89,28	\$ 729	14	86,79	\$ 744	14	79,19
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	58	4	94,15	53	4	92,87	65	5	85,94
Klasse A EUR Thesaurierend	94	–	167,77	212	1	176,24	160	1	146,52
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	664	4	142,61	537	4	134,12	493	4	118,29
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	27	–	97,80	22	–	93,99	18	–	84,80
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	157	12	103,52	228	18	98,75	122	11	89,70
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	448	612	0,93	323	478	0,91	223	357	0,84
Klasse C USD Thesaurierend	997	5	187,64	973	6	173,65	834	6	151,10
Klasse C USD Ausschüttend (A)	114	1	151,64	106	1	140,09	121	1	122,38
Klasse C USD Ausschüttend (Q)	60	–	139,67	80	1	129,50	84	1	112,99
Klasse F USD Thesaurierend	16.559	85	194,44	18.371	103	178,17	17.286	113	153,44
Klasse F EUR Thesaurierend	82	–	179,53	75	–	187,39	64	–	154,89
Klasse F EUR Ausschüttend (A)	72	–	140,73	67	–	148,39	90	1	124,35
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	73	1	121,45	61	1	115,82	57	1	103,79
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 18.217	90	201,78	\$ 31.949	176	181,53	\$ 50.323	297	169,20
Klasse A USD Ausschüttend (A)	2.463	8	316,34	5.105	18	284,60	9.959	38	265,27
Klasse A EUR Thesaurierend	3	–	119,48	331	3	122,45	5.603	47	109,50
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	9.020	30	254,67	11.192	46	233,68	18.698	78	221,81
Klasse A SEK Thesaurierend	58.384	3.219	163,74	58.942	3.618	175,40	60.611	3.998	157,16
Klasse F USD Thesaurierend	847	4	208,95	1.145	6	186,86	3.388	20	173,12
Klasse X USD Thesaurierend	306	2	175,04	947	6	156,39	4.617	32	144,80
Klasse X USD Ausschüttend (A)	180	1	336,97	198	1	301,05	343	1	278,75
Klasse X EUR Thesaurierend	53	–	139,41	992	7	142,15	7.021	51	126,38
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	5.660	18	272,03	4.776	19	247,78	7.064	28	233,57
Klasse X GBP Thesaurierend	40.126	83	356,61	105.671	246	341,70	277.252	696	315,54
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	259	1	175,79	945	5	157,36	852	5	146,50
Klasse Premier USD Thesaurierend	18.020	94	190,85	20.314	119	170,08	97.282	620	157,03
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	6.810	20	340,50	6.082	20	304,10	6.015	21	281,62
Klasse Premier EUR Thesaurierend	2	–	129,62	1	–	131,34	1	–	116,19
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.997	8	256,13	2.870	11	240,74
Klasse Premier GBP Thesaurierend	13.223	25	389,75	36.868	79	372,48	22.333	52	342,96
Klasse P2 USD Thesaurierend	19.377	78	247,18	298.796	1.359	219,84	500.641	2.472	202,56
Klasse P2 EUR Thesaurierend	53.229	252	178,92	95.543	508	181,43	80.725	466	160,45
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	189.669	958	167,61	4.555	29	151,92	1.893	12	142,35
Klasse P2 GBP Thesaurierend	62.546	242	191,73	102.810	447	182,77	92.089	435	167,88
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	50.219	200	186,74	48.538	232	166,39	60.674	312	154,07
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	19.360	77	186,15	27.904	125	177,99	16.831	81	164,24
Klasse LM EUR Thesaurierend	60.443	358	142,91	55.755	373	144,21	38.425	280	127,04
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 42.685	193	221,53	\$ 991	5	197,85	\$ 861	5	172,21
Klasse A USD Ausschüttend (A)	12.712	129	98,25	–	–	–	–	–	–
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	2.632	38	97,93	–	–	–	–	–	–
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	27	–	96,91	–	–	–	–	–	–
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	68	5	97,46	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend	5.305	47	95,83	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	625	5	97,59	–	–	–	–	–	–
Klasse A GBP Thesaurierend	91	1	95,77	–	–	–	–	–	–
Klasse A HKD Thesaurierend	115	9	98,91	–	–	–	–	–	–
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31	3	97,40	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1.377	1.790	0,97	–	–	–	–	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (A)	5	–	98,10	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD Thesaurierend	5.940	53	111,63	1	–	100,07	–	–	–
Klasse C USD Ausschüttend (A)	8.087	82	98,09	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	3.771	34	111,35	1	–	100,06	–	–	–
Klasse E USD Ausschüttend (A)	779	8	98,01	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR Thesaurierend	14	–	95,60	–	–	–	–	–	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	28	–	97,35	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	7.564	67	113,17	1	–	100,37	–	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (A)	72	1	98,44	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD Thesaurierend	3.487	35	98,56	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)	656	7	98,56	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend	50	–	96,15	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	26	–	97,90	–	–	–	–	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend	9.259	68	100,50	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	24.556	103	239,22	26.334	125	211,49	15.857	87	182,25
Klasse Premier EUR Thesaurierend	1.990	18	96,16	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend	233	2	96,09	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	129	1	98,43	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	25.211	195	96,09	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	10.143	89	114,09	1	–	100,48	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend	1	–	99,00	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend	4.717	35	101,04	–	–	–	–	–	–
Klasse A (G) USD Thesaurierend	15.713	160	98,36	–	–	–	–	–	–
Klasse B (G) USD Thesaurierend	9	–	98,19	–	–	–	–	–	–
Klasse L (G) USD Thesaurierend	5.735	58	98,20	–	–	–	–	–	–
Klasse GA EUR Thesaurierend	185	2	95,91	–	–	–	–	–	–
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	87	1	95,91	–	–	–	–	–	–
Klasse GE USD Thesaurierend	88	1	98,08	–	–	–	–	–	–
Klasse GE EUR Thesaurierend	50	–	95,68	–	–	–	–	–	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	€ 25.802	1.645	18,53	€ 10.224	762	13,92	€ 8.869	754	12,72
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	36.891	2.008	21,71	44.262	2.518	18,23	32.739	2.248	15,74
Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	40.030	3.647	12,97	37.806	3.389	11,57	34.959	3.575	10,57
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	187	16	13,40	11	1	10,46	4	–	9,96
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	2.130	124	20,27	1.984	134	15,37	2.347	179	14,17
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1.742	236	12,24	1.943	296	10,96	2.402	399	10,00
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	11.235	7.359	12,38	11.127	7.574	11,12	26.118	19.835	10,26
Klasse A EUR Thesaurierend	332.149	16.994	19,54	144.310	8.638	16,71	124.782	8.513	14,66
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	11.720	727	16,13	3.582	274	13,10	3.123	265	11,78
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	3.286	261	12,60	1.178	108	10,86	428	45	9,60
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	4.713	315	14,98	2.886	216	13,34	3.614	297	12,18
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	5.784	6.931	1,25	4.560	5.711	1,12	4.622	6.557	1,03
Klasse C USD Thesaurierend	1.377	93	17,51	783	61	13,22	1.311	117	12,14
Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	795	47	20,19	1.110	68	17,03	945	69	14,79
Klasse E USD Thesaurierend	4.858	283	20,26	3.853	261	15,32	4.305	330	14,11
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	627	45	16,52	1.221	91	13,95	1.123	100	12,15
Klasse E EUR Thesaurierend	5.045	385	13,11	965	85	11,29	90	9	9,98
Klasse E EUR Ausschüttend (A)	281	21	13,08	171	15	11,28	1	–	9,99
Klasse F USD Thesaurierend	5.626	344	19,33	3.675	264	14,43	4.669	385	13,12
Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	4.648	248	22,17	8.286	465	18,50	4.774	325	15,88
Klasse X USD Thesaurierend	1.003	62	19,10	460	34	14,20	251	21	12,87
Klasse X USD Ausschüttend (A)	595	38	18,39	178	13	13,90	364	31	12,80
Klasse X EUR Thesaurierend	55.096	2.684	20,53	26.936	1.549	17,39	23.612	1.562	15,12
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	22.586	1.334	16,93	1.529	112	13,60	1.783	147	12,12
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	1.699	90	16,53	2.716	167	13,43	1.800	125	12,34
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	–	–	–	82	7	9,98	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	151.820	7.164	25,04	50.977	2.840	18,62	38.426	2.467	16,84
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	1.155	200	35,04	935	212	26,90	1.196	290	22,13
Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	54.319	5.549	15,78	46.579	5.376	13,00	42.027	5.220	11,81
Klasse Premier EUR Thesaurierend	246.643	7.396	33,35	189.442	6.719	28,19	333.314	13.624	24,46

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:	Gesamt-NIWI (in Tsd.)	Anz. Anteile (in Tsd.)	NIWI/ Anteil:
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ (Fortsetzung)									
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	€ 30.771	1.701	18,09	€ 7.710	531	14,53	€ 7.864	609	12,91
Klasse Premier GBP Thesaurierend	106	4	23,45	117	5	18,65	119	6	16,81
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	3.149	92	30,06	3.195	108	24,31	4.434	174	21,88
Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	13.288	616	18,92	14.642	786	15,37	60.352	3.661	14,12
Klasse S EUR Thesaurierend	157.954	11.319	13,95	104.736	8.890	11,78	46.156	4.524	10,20
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 15.638	109	144,03	\$ 13.476	127	106,04	\$ 19.511	203	96,21
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	34.999	309	113,30	30.885	348	88,77	44.714	522	85,66
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	26.052	217	119,94	31.440	343	91,71	45.099	517	87,17
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	6.790	93	102,62	5.314	105	81,46	5.774	111	79,69
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	6.959	474	100,75	1.185	107	81,15	1.489	133	80,49
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	481	4	100,75	159	2	88,33	99	1	80,98
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	13.031	111	99,08	5.603	68	79,67	7.044	83	78,50
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	3.557	25	104,71	4.330	42	82,53	4.675	46	80,15
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	243	17	114,78	528	46	89,40	702	63	86,86
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	56.296	69.493	1,02	42.374	69.310	0,83	50.922	84.124	0,81
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	2.525	20	124,40	1.134	12	94,39	1.120	13	89,03
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	78	1	108,13	83	1	83,29	275	3	79,26
Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	3.873	29	111,75	622	7	86,94	813	9	83,64
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	944	6	113,35	223	2	86,54	213	2	82,10
Klasse Premier USD Thesaurierend	30.836	234	131,91	10.914	114	96,12	1.960	23	86,30
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	62.425	536	116,53	86.588	958	90,37	61.976	718	86,28
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	5.517	40	117,01	573	6	89,97	27.600	298	85,67
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	122,85	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	1.292	9	145,18	1.787	17	105,63	10.229	108	94,68
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	23.163	162	143,24	4.379	40	108,31	4.918	48	101,66
Klasse S EUR Thesaurierend	11.474	73	133,49	6.636	58	110,62	3.218	31	95,14
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	293	2	138,18	242	2	107,08	–	–	–
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	5.122	34	126,18	121	2	108,59	8	–	97,80
Klasse S GBP Thesaurierend	4.113	23	132,50	3.438	26	103,29	3.453	30	92,34
Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	536	3	151,03	615	4	110,61	315	2	99,87
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	4.012	21	140,39	1.115	8	106,79	219	2	100,84
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	58.362	360	120,42	3.141	26	97,65	643	6	91,32
Klasse P2 USD Thesaurierend	37.258	241	154,66	25.888	230	112,32	29.372	292	100,48
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	2.221	19	119,54	4.356	47	92,38	5.448	62	87,89
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^*									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 53	–	162,84	\$ 13	–	131,42	\$ 11	–	112,17
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	17	14	1,54	13	14	1,28	11	14	1,11
Klasse Premier USD Thesaurierend	17	–	166,87	13	–	133,34	11	–	112,65
Klasse P2 USD Thesaurierend	8.330	50	168,29	6.633	50	134,01	5.585	50	112,82
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	18	–	160,10	13	–	130,30	11	–	111,80
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	18	–	165,78	14	–	132,58	12	–	112,40
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 153.817	376	408,94	\$ 161.633	514	314,38	\$ 141.806	466	304,22
Klasse A USD Ausschüttend (A)	37.624	30	1.241,94	35.357	37	954,75	28.296	31	923,89
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	6.004	29	292,35	4.813	34	228,46	5.382	37	224,42
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	587	16	254,18	1.860	67	201,14	3.238	117	199,58
Klasse A EUR Thesaurierend	94.062	176	452,21	84.890	207	395,98	29.710	75	368,07
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	65.037	194	283,74	17.686	77	222,16	8.088	34	218,83
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	94	–	215,77	228	1	168,92	184	1	166,42
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	141	–	244,53	125	1	188,59	143	1	183,61
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	617	1	479,02	733	1	394,53	595	1	380,55
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	505	17	274,84	106	5	216,18	64	3	213,92
Klasse A SGD Thesaurierend	4.428	1.487	3,77	4.633	2.021	3,10	5.678	2.559	2,99
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	22.690	7.926	3,62	21.731	10.263	2,86	36.958	17.608	2,82
Klasse B USD Thesaurierend	18	–	416,07	17	–	321,46	17	–	312,65
Klasse B USD Ausschüttend (A)	19	–	1.112,70	14	–	859,69	14	–	836,05
Klasse C USD Thesaurierend	10.687	26	416,79	14.117	44	322,01	9.883	32	313,17
Klasse C USD Ausschüttend (A)	4.350	4	1.105,51	4.425	5	854,11	5.516	7	830,66
Klasse E USD Thesaurierend	15.282	41	369,59	22.026	77	286,25	10.942	39	279,09
Klasse E USD Ausschüttend (A)	1.115	3	369,53	845	3	286,21	636	2	279,05
Klasse E EUR Thesaurierend	9.144	17	448,65	7.400	18	395,73	2.933	7	370,44
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.911	7	221,51	2.961	16	174,79	2.886	15	173,49
Klasse F USD Thesaurierend	12.970	29	452,81	13.946	40	346,02	11.899	36	332,82
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1.551	3	453,28	602	2	346,39	295	1	333,18
Klasse R EUR Thesaurierend	422	1	360,37	334	1	314,01	321	1	290,18
Klasse X USD Thesaurierend	42.312	105	403,33	40.309	131	307,76	57.413	194	295,58
Klasse X USD Ausschüttend (A)	4.161	15	279,64	3.629	17	213,37	1.193	6	204,93
Klasse X EUR Thesaurierend	21.040	76	233,03	44.340	211	202,54	10.914	54	186,75
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	49.869	163	258,24	28.417	137	200,55	13.486	64	196,18
Klasse X GBP Thesaurierend	28.384	43	485,48	42.328	85	397,13	36.189	75	380,13
Klasse X GBP Ausschüttend (A)	3.616	6	444,68	2.206	5	363,54	2.614	6	348,01
Klasse Premier USD Thesaurierend	359.289	668	537,57	311.254	761	408,75	170.380	436	391,20
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	1.453	25	293,85	1.279	36	208,82	5.565	143	194,04
Klasse Premier EUR Thesaurierend	74.182	95	657,44	63.241	107	569,60	39.297	69	523,29
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.410	58	282,71	15.759	69	219,06	13.882	60	213,51
Klasse Premier GBP Thesaurierend	35.298	56	466,63	25.295	53	380,42	30.462	67	362,88
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	5.571	92	217,29	5.795	142	164,72	8.011	203	157,42
FTGF Royce US Smaller Companies Fund									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 32.259	104	308,79	\$ 30.267	122	248,21	\$ 34.706	135	256,17
Klasse A USD Ausschüttend (A)	9.307	18	522,14	7.812	19	419,92	9.278	21	433,55
Klasse A EUR Thesaurierend	8.916	17	455,53	5.769	13	417,24	1.340	3	413,38
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1.727	7	200,81	320	2	164,23	188	1	172,53
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	–	1	322,52	242	1	295,44	229	1	292,77
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	59	–	405,71
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	201,35	–	–	164,37	3	–	173,53
Klasse C USD Thesaurierend	3.206	11	295,10	3.046	13	238,40	3.180	13	247,28
Klasse C USD Ausschüttend (A)	1.639	4	465,74	2.056	5	376,43	2.725	7	390,60
Klasse E USD Thesaurierend	1.148	4	313,36	993	4	253,91	866	3	264,13
Klasse E USD Ausschüttend (A)	–	–	–	–	–	–	8	–	155,41
Klasse E EUR Thesaurierend	98	–	184,78	143	1	170,50	9	–	170,42
Klasse F USD Thesaurierend	12.158	31	389,25	14.838	48	311,18	15.526	49	319,35
Klasse F USD Ausschüttend (A)	413	1	416,39	690	2	332,88	546	2	341,62
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	19	–	231,43
Klasse X USD Ausschüttend (A)	15	–	130,01	29	–	103,78	2	–	106,26
Klasse Premier USD Thesaurierend	406	1	433,67	506	1	344,97	10.847	31	352,30
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	14.517	48	300,77	13.010	54	239,56	12.258	50	245,06
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	1.969	4	357,75	1.781	5	305,31	2.049	5	311,23
Klasse P2 USD Thesaurierend	1	–	119,91	1	–	94,94	–	–	–
Klasse LM EUR Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	327	1	248,09
Klasse A (G) USD Thesaurierend	817	2	352,28	718	3	281,62	941	3	289,01
Klasse L (G) USD Thesaurierend	737	2	320,39	631	2	257,41	829	3	265,50
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 10	–	98,35	\$ 8	–	83,36	\$ 9	–	85,46
Klasse X USD Thesaurierend	10	–	101,84	9	–	85,52	9	–	86,92
Klasse X GBP Thesaurierend	18	–	106,04	2	–	95,25	6	–	96,54
Klasse Premier USD Thesaurierend	5.132	50	103,06	4.303	50	86,39	4.362	50	87,60

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	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 Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^{^μ}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 1.078	6	190,61	\$ 4.955	24	203,06
Klasse A EUR Thesaurierend	–	–	–	2.567	12	203,20	5.474	24	207,83
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	6.851	76	86,49	16.784	165	94,05
Klasse C USD Thesaurierend	–	–	–	10	–	80,33	192	2	86,03
Klasse E USD Thesaurierend	–	–	–	882	7	123,90	2.144	16	133,00
Klasse F USD Thesaurierend	–	–	–	75	1	83,08	155	2	87,97
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	114	1	100,06
Klasse X EUR Thesaurierend	–	–	–	89	–	216,99	247	1	220,00
Klasse X GBP Thesaurierend	–	–	–	744	3	213,04	1.557	6	224,16
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.501	7	177,69	3.054	13	189,03
Klasse Premier USD Thesaurierend	–	–	–	1.502	7	209,38	14.030	64	220,60
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	23	–	131,95
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	23	–	91,90	58.905	553	98,52
Klasse P2 GBP Thesaurierend	–	–	–	6.174	21	228,37	16.387	54	239,25
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^]									
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	\$ –	–	–	\$ –	–	–	\$ 1	–	102,33
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	4.472	54	83,34
Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	448	7	95,96
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	454	5	85,20
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	43	71	0,82
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	42	–	96,98
Klasse D USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	4.158	36	116,92
Klasse D AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	21	–	90,80
Klasse D CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	1	–	92,05
Klasse D HKD Ausschüttend (M) Plus	–	–	–	–	–	–	1	–	98,04
Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	–	–	–	–	–	–	227	325	0,94
Klasse X USD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	5.843	45	128,70
Klasse X AUD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	199	2	135,41
Klasse P1 GBP Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	500	3	143,09
Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)	–	–	–	–	–	–	491	4	98,12
Klasse LM AUD Thesaurierend	–	–	–	–	–	–	4.243	47	139,35
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund^{^*}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 1.300	9	142,28	\$ 2.561	27	94,99	\$ 4.368	49	89,74
Klasse E USD Thesaurierend	316	2	154,74	214	2	104,07	203	2	99,06
Klasse F USD Thesaurierend	7.216	39	183,52	11.941	98	121,78	14.174	124	114,36
Klasse X USD Thesaurierend	3	–	157,74	2	–	104,52	2	–	98,01
Klasse Premier USD Thesaurierend	8.770	54	162,48	6.160	57	107,28	1.886	19	100,24
Klasse S GBP Thesaurierend	2.203	15	109,66	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	32	–	198,66	129	1	130,92	233	2	122,08
Klasse P2 EUR Thesaurierend	441	2	157,42	10.946	89	118,33	10.781	94	105,90
FTGF Franklin European Unconstrained Fund^{^φ*}									
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	€ –	–	–	€ –	–	–	€ 31	–	96,69
Klasse A EUR Thesaurierend	–	–	–	1.275	8	150,39	1.873	12	160,37
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	30	–	94,98
Klasse X EUR Thesaurierend	–	–	–	571	4	157,66	683	4	166,86
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	–	–	–	768	33	123,89
Klasse Premier EUR Thesaurierend	–	–	–	8	–	161,19	991	6	169,99
Klasse P1 USD Thesaurierend	–	–	–	203	2	120,94	1	–	132,29
Klasse P1 EUR Thesaurierend	–	–	–	9.801	69	142,18	84.273	564	149,33
Klasse P1 GBP Thesaurierend	–	–	–	71.158	733	80,08	100.228	982	87,35
Klasse P2 EUR Thesaurierend	–	–	–	1	–	107,31	–	–	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^{^Ω}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ –	–	–	\$ 104	1	105,01	\$ 97	1	97,47
Klasse X GBP Thesaurierend	–	–	–	2	–	123,66	1	–	113,48
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	1.129	8	106,87	851	7	99,05
Klasse P1 USD Thesaurierend	–	–	–	5.093	47	108,37	4.640	47	98,72
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	99	1	104,66	96	1	97,23
Klasse P1 GBP Thesaurierend	–	–	–	1.068	7	125,27	2	–	113,84
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	–	–	–	390	3	107,06	499	4	98,16
Klasse P2 GBP Thesaurierend	–	–	–	7.651	59	103,90	–	–	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]									
Klasse A EUR Thesaurierend	€ 7.154	63	112,85	€ 8.493	77	110,01	€ 10.087	97	104,08
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	38.266	364	105,01	43.301	409	105,99	44.990	432	104,14
Klasse D EUR Thesaurierend	664	6	110,94	811	7	108,74	1.157	11	103,46
Klasse D EUR Ausschüttend (A)	212	2	104,37	214	2	105,34	210	2	103,45
Klasse X EUR Thesaurierend	448	4	114,23	499	4	110,91	491	5	104,52
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	24.107	229	105,45	29.633	278	106,43	30.769	294	104,60
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]									
Klasse A EUR Thesaurierend	€ 7.249	67	108,65	€ 7.630	72	105,58	€ –	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	25.416	240	105,90	26.343	250	105,58	–	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	4.555	43	106,33	5.173	49	105,98	–	–	–
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund^{^ψ}									
Klasse A EUR Thesaurierend	€ 1	–	100,04	€ –	–	–	€ –	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M)	1	–	100,05	–	–	–	–	–	–
Klasse A1 EUR Thesaurierend	1	–	100,03	–	–	–	–	–	–
Klasse A1 EUR Ausschüttend (M)	1	–	100,03	–	–	–	–	–	–
Klasse K EUR Thesaurierend	1	–	100,03	–	–	–	–	–	–
Klasse K EUR Ausschüttend (M)	1	–	100,03	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend	4.996	50	100,05	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M)	1	–	100,06	–	–	–	–	–	–
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^{^γ}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 793.707	7.623	104,12	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1	–	104,05	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (D)	109.556	1.091	100,40	–	–	–	–	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (M)	10.202	101	100,73	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	101,96	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1.255	16	100,26	–	–	–	–	–	–
Klasse AX USD Thesaurierend	262.219	2.524	103,88	–	–	–	–	–	–
Klasse AX USD Ausschüttend (D)	14.470	144	100,40	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	9.222	89	103,41	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Ausschüttend (D)	6.480	65	100,41	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	127.557	1.222	104,35	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (D)	57.139	569	100,40	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD Thesaurierend	1	–	104,15	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	102,22	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	1	–	104,41	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	102,27	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	104,14	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	11	–	100,27	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	100.155	959	104,41	–	–	–	–	–	–
S Klasse EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	102,27	–	–	–	–	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend	50.575	500	101,15	–	–	–	–	–	–
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^{^δ}									
Klasse A USD Ausschüttend (M)	\$ 2.579	24	106,27	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (M)	611	6	106,25	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD Ausschüttend (M)	1.440	14	106,23	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (M)	1	–	104,28	–	–	–	–	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Bilanz – (Fortsetzung)

	28. Februar 2026			28. Februar 2025			29. Februar 2024		
	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 Franklin Global High Yield Bond Fund^Δ (Fortsetzung)									
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	\$ 3.487	33	106,34	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	9	–	104,30	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	17.952	119	111,55	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1	–	106,06	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	6.055	47	109,77	–	–	–	–	–	–
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^{Δλ}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 21.073	161	131,00	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend	6	–	117,98	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	11.939	90	132,30	–	–	–	–	–	–
S Klasse EUR Thesaurierend (Abgesichert)	38.697	252	129,81	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend	1.730	15	95,21	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend	1	–	126,74	–	–	–	–	–	–
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund^{Δα}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 45.625	370	123,20	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend	2.939	22	113,59	–	–	–	–	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	842	6	113,68	–	–	–	–	–	–
Klasse C USD Thesaurierend	186	2	122,50	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	11.631	95	122,19	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	16.673	135	123,80	–	–	–	–	–	–
Klasse X USD Thesaurierend	733	6	124,13	–	–	–	–	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend	1	–	114,46	–	–	–	–	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend	5	–	127,24	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	24.244	195	124,27	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend	1	–	119,68	–	–	–	–	–	–
Klasse S USD Thesaurierend	94.628	760	124,51	–	–	–	–	–	–
Klasse S GBP Thesaurierend	1	–	119,79	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend	123.062	988	124,59	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 USD Ausschüttend (M)	1	–	99,92	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	605	4	120,14	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend	36.770	3	11.498,17	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	57.164	4	11.033,44	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend	101.918	632	119,66	–	–	–	–	–	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1	–	124,51	–	–	–	–	–	–
FTGF Putnam Balanced Fund^{Δβ}									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 2.695	24	112,96	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse C USD Thesaurierend	1.730	15	112,65	–	–	–	–	–	–
Klasse D USD Thesaurierend	162.359	1.434	113,22	–	–	–	–	–	–
Klasse E USD Thesaurierend	47.685	425	112,31	–	–	–	–	–	–
Klasse F USD Thesaurierend	5.909	52	113,44	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	66	1	113,77	–	–	–	–	–	–
FTGF Putnam Global Healthcare Fund^Δ									
Klasse A USD Thesaurierend	\$ 221	2	122,54	\$ –	–	–	\$ –	–	–
Klasse A HKD Thesaurierend	1	–	122,47	–	–	–	–	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,20	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend	3.703	30	123,64	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	2	–	118,89	–	–	–	–	–	–
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1	1	1,21	–	–	–	–	–	–

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

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

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

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

γ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^Δ den Handel auf.

δ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^Δ den Handel auf.

λ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^Δ den Handel auf.

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

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

Ω Mit Wirkung vom 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund^Δ den Handel ein.

η Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^Δ den Handel ein.

φ Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund^Δ den Handel ein.

μ Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 hat der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^Δ den Handel eingestellt.

Ψ Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund^Δ den Handel auf.

* Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsamen und Verschmelzungen sind der Erläuterung 14 zu entnehmen.

Δ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Gesamtergebnisrechnung

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^	
	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 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 78.446	\$ 71.235	\$ 3.787	\$ 5.899	\$ 7.207	\$ 24.210	€ –	€ 409
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	30	11	–	5
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	-40	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	5	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	-389	-4.578	-4.904	-46.581	–	-4.605
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	2.527	6.613	9.950	57.831	–	4.592
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	78.446	71.235	5.925	7.934	12.283	35.431	5	401
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	10.912	8.201	641	906	1.495	3.428	–	16
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	484	366	78	112	173	444	–	14
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	84	111	139	220	–	1
Rechtskosten	39	37	4	6	15	30	–	1
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	22	21	45	42	45	42	–	12
Druckkosten	46	36	4	5	17	32	–	2
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	30	5	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	25	15	1	2	3	7	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	5	–
Sonstige Aufwendungen	393	255	52	62	147	207	–	24
Aufwendungen gesamt	11.921	8.931	909	1.246	2.064	4.415	5	70
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-86	–	-47	-37	-51	-27	–	-16
Gesamtnettoaufwendungen	11.835	8.931	862	1.209	2.013	4.388	5	54
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	66.611	62.304	5.063	6.725	10.270	31.043	–	347
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-51.126	-48.373	-1.307	-1.886	-1.357	-2.322	–	-20
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	15.485	13.931	3.756	4.839	8.913	28.721	–	327
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	2	7	-8	-12	–	4
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 15.485	\$ 13.931	\$ 3.758	\$ 4.846	\$ 8.905	\$ 28.709	€ –	€ 331
(in Tsd.)	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^		FTGF Western Asset Asian Opportunities 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 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 6.257	\$ 9.875
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	1
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	-11	-82
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	-1.292	-10.690
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	11.286	11.317
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	–	–	–	–	–	16.240	10.421
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	1.367	1.891
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	137	193
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	130	174
Rechtskosten	–	–	–	–	–	–	6	11
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	45	42
Druckkosten	–	–	–	–	–	–	7	11
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	1
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	2	3
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	–	–	–	–	133	145
Aufwendungen gesamt	–	–	–	–	–	–	1.827	2.471
Erlass/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	-4	-1
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	–	–	–	–	1.823	2.470
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	–	–	–	–	14.417	7.951
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	–	-3.752	-5.535
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	–	–	–	–	10.665	2.416
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	–	–	–	–	-173	-295
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 10.492	\$ 2.121

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^		FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ -	\$ -	\$ 10.688	\$ 13.498	\$ 5.794	\$ 7.874	\$ -	\$ -	\$ 2.365	\$ 3.275
-	-	1	9	1	-	-	-	-	1
-	-	250	56	21	-12	-	-	6	-2
-	-	-	-	-	-	-	5	-	-
-	-	1.747	-14.217	-362	-602	-	-	223	-1.556
-	-	13.369	12.011	1.663	2.359	-	-	1.603	2.604
-	-	26.055	11.357	7.117	9.619	-	5	4.197	4.322
-	-	1.389	1.309	696	719	-	-	373	429
-	-	172	200	71	83	-	-	38	44
-	-	103	92	86	85	-	-	48	60
-	-	7	8	2	3	-	-	1	2
-	-	45	42	30	28	-	-	30	28
-	-	7	8	3	4	-	-	1	2
-	-	-	-	1	-	-	-	-	-
-	-	3	3	1	1	-	-	1	-
-	-	-	-	-	-	-	5	-	-
-	-	144	150	54	79	-	-	53	78
-	-	1.870	1.812	944	1.002	-	5	545	643
-	-	-36	-22	-38	-48	-	-	-52	-58
-	-	1.834	1.790	906	954	-	5	493	585
-	-	24.221	9.567	6.211	8.665	-	-	3.704	3.737
-	-	-5.386	-6.694	-2.968	-3.850	-	-	-1.809	-2.386
-	-	18.835	2.873	3.243	4.815	-	-	1.895	1.351
-	-	-44	-99	-9	-11	-	-	16	-2
\$ -	\$ -	\$ 18.791	\$ 2.774	\$ 3.234	\$ 4.804	\$ -	\$ -	\$ 1.911	\$ 1.349
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Bond Fund^*		FTGF Western Asset Global Credit Fund^		FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund^		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ 5.382	\$ 12.367	\$ 3.014	\$ 3.720	\$ 601	\$ 1.222	\$ -	\$ 39.116	\$ 25.066	\$ 31.534
1	17	-	4	-	1	-	25	1	7
-19	-272	-	-	-	-	-	-27	-	-
-	-	-	-	-	-	534	-	-	-
83	-247	-966	-5.520	-725	-804	1.964	-27.598	31.073	-17.768
12.304	11.587	6.343	1.223	1.229	1.585	-	3.819	-6.918	11.294
17.751	23.452	8.391	-573	1.105	2.004	2.498	15.335	49.222	25.067
857	1.542	83	126	3	5	-	7.655	503	381
156	324	84	90	17	30	-	473	297	323
84	131	1	2	-	1	-	633	-	-
9	16	3	5	1	1	-	27	10	11
30	28	30	28	30	27	-	10	30	28
10	16	3	5	1	1	-	-	13	14
-	1	-	-	-	-	-	10	1	2
3	5	1	1	-	-	-	8	5	5
-	-	-	-	-	-	2.498	-	-	-
106	142	87	72	28	33	-	122	140	101
1.255	2.205	292	329	80	98	2.498	8.938	999	865
-28	-15	-8	-3	-32	-	-	-74	-	-
1.227	2.190	284	326	48	98	2.498	8.864	999	865
16.524	21.262	8.107	-899	1.057	1.906	-	6.471	48.223	24.202
-3.114	-9.363	-	-	-	-	-	-10.398	-1.686	-1.718
13.410	11.899	8.107	-899	1.057	1.906	-	-3.927	46.537	22.484
-2	8	-7	-33	-	-	-	-457	-63	-68
\$ 13.408	\$ 11.907	\$ 8.100	\$ -932	\$ 1.057	\$ 1.906	\$ -	\$ -4.384	\$ 46.474	\$ 22.416

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	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	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 34.453	\$ 38.866	\$ 40.513	\$ 43.384	£ –	£ –	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	1	15	–	1	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	-11	3	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	2
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-55.706	-68.156	-487	-16.223	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	55.671	83.939	45.401	52.394	–	–	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	34.408	54.667	85.427	79.556	–	–	–	2
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	144	378	189	183	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	433	422	955	952	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	5	6	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	14	18	33	38	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	45	42	30	28	–	–	–	–
Druckkosten	16	20	33	37	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	5	15	–	1	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	7	6	16	14	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	2
Sonstige Aufwendungen	163	122	228	197	–	–	–	–
Aufwendungen gesamt	832	1.029	1.484	1.450	–	–	–	2
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	832	1.029	1.484	1.450	–	–	–	2
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	33.576	53.638	83.943	78.106	–	–	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-457	-870	-1	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	33.119	52.768	83.942	78.106	–	–	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-275	-118	–	–	–	–	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 32.844	\$ 52.650	\$ 83.942	\$ 78.106	£ –	£ –	\$ –	\$ –
(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{Δ,η}		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{Δ,π}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 12.497	\$ 12.364	\$ 58.804	\$ 81.538	\$ 163	\$ 1.275	\$ –	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	1	55	12	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	1	-1	-687	-347	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	-4.711	-12.553	25.481	-50.792	-235	-4	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	17.348	-3.233	8.589	11.062	-153	69	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	25.135	-3.422	92.242	41.473	-225	1.340	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	1.218	1.212	5.392	7.721	28	159	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	176	168	645	891	11	24	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	3	5	584	837	1	3	–	–
Rechtskosten	5	7	28	39	–	1	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	30	28	45	42	18	28	–	–
Druckkosten	6	7	30	37	–	1	–	–
Zinsaufwendungen	–	2	55	13	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	2	2	11	13	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	114	96	314	379	12	40	–	–
Aufwendungen gesamt	1.554	1.527	7.104	9.972	70	256	–	–
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	-12	-3	-38	-73	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	1.554	1.527	7.092	9.969	32	183	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	23.581	-4.949	85.150	31.504	-257	1.157	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-29	-94	-28.376	-32.790	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	23.552	-5.043	56.774	-1.286	-257	1.157	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-1.016	-11	-1.130	-478	1	3	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 22.536	\$ -5.054	\$ 55.644	\$ -1.764	\$ -256	\$ 1.160	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund ^Δ		FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund ^{ΔΠ}		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global High Yield Fund ^Δ	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ 747	\$ 810	\$ –	\$ –	\$ 2.623	\$ 5.601	\$ 7.921	\$ 9.941	\$ 3.974	\$ 2.722
–	–	–	–	–	1	–	1	–	–
1	–	–	–	-21	–	–	-16	-2	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-182	-63	–	–	1.177	-9.932	-1.887	241	1.658	-409
583	-96	–	–	1.500	6.088	6.938	-4.345	-1.288	-604
1.149	651	–	–	5.279	1.758	12.972	5.822	4.342	1.709
–	–	–	–	373	723	898	1.210	373	186
20	20	–	–	62	99	92	116	52	34
–	–	–	–	63	93	4	6	36	14
–	1	–	–	3	5	4	7	1	1
30	28	–	–	45	42	30	28	30	28
1	–	–	–	3	5	6	13	1	1
–	–	–	–	–	68	–	3	–	–
–	–	–	–	1	1	2	1	1	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
27	26	–	–	79	140	83	105	54	44
78	75	–	–	629	1.176	1.119	1.489	548	308
-78	-75	–	–	-10	–	–	-1	-57	-56
–	–	–	–	619	1.176	1.119	1.488	491	252
1.149	651	–	–	4.660	582	11.853	4.334	3.851	1.457
-839	-934	–	–	-652	-1.418	-13	-263	-1.333	-1.017
310	-283	–	–	4.008	-836	11.840	4.071	2.518	440
-2	-2	–	–	-348	100	-331	-206	1	-5
\$ 308	\$ -285	\$ –	\$ –	\$ 3.660	\$ -736	\$ 11.509	\$ 3.865	\$ 2.519	\$ 435
FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund ^Δ		FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund ^{ΔΠ}	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.113	\$ –	\$ 852	\$ 1.778	\$ 1.754	\$ –	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	5	–
–	–	–	-3.234	15	6	232	482	–	–
–	–	–	1.731	-15	-397	208	-294	–	–
–	–	–	610	–	461	2.218	1.942	5	–
–	–	–	1	–	46	75	70	–	–
–	–	–	22	–	15	36	33	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	6	–	6	1	1	–	–
–	–	–	13	–	–	20	21	–	–
–	–	–	–	–	1	1	1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	5	–
–	–	–	-34	–	20	18	21	–	–
–	–	–	8	–	88	151	147	5	–
–	–	–	-10	–	-58	-20	-24	–	–
–	–	–	-2	–	30	131	123	5	–
–	–	–	612	–	431	2.087	1.819	–	–
–	–	–	–	–	-11	–	–	–	–
–	–	–	612	–	420	2.087	1.819	–	–
–	–	–	55	–	8	-21	-1	–	–
\$ –	\$ –	\$ –	\$ 667	\$ –	\$ 428	\$ 2.066	\$ 1.818	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		FTGF Putnam US Research Fund [*]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 1.392	\$ –	\$ 15.342	\$ 25.014	\$ –	\$ –	\$ 7.232	\$ 2.611
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	1	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	-22	11	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	3.314	–	62.469	260.411	–	–	80.950	38.255
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	7.772	–	23.850	-86.970	–	–	5.821	-10.111
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	12.478	–	101.639	198.466	–	–	94.004	30.755
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	6.877	10.358	–	–	3.465	2.297
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	43	–	728	1.109	–	–	502	170
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	1.053	1.257	–	–	404	375
Rechtskosten	2	–	32	38	–	–	14	7
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	18	–	22	21	–	–	30	28
Druckkosten	1	–	35	34	–	–	17	6
Zinsaufwendungen	–	–	29	13	–	–	11	1
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	14	15	–	–	4	2
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	69	–	294	308	–	–	181	88
Aufwendungen gesamt	133	–	9.084	13.153	–	–	4.628	2.974
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-133	–	-205	-226	–	–	-381	-55
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	8.879	12.927	–	–	4.247	2.919
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	12.478	–	92.760	185.539	–	–	89.757	27.836
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	-153	-138	–	–	-3	-10
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	12.478	–	92.607	185.401	–	–	89.754	27.826
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-256	–	-3.871	-6.559	–	–	-1.969	-731
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 12.222	\$ –	\$ 88.736	\$ 178.842	\$ –	\$ –	\$ 87.785	\$ 27.095

(in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund ^{^*}		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025	28. Februar 2026	28. Februar 2025
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividenderträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	€ 27.849	€ 25.379	\$ 13.604	\$ 16.187	\$ 165	\$ 151	\$ 7.570	\$ 8.920
Zinsen (Erläuterung 2)	16	46	–	1	–	–	–	2
Ausgleich (Erläuterung 2)	12	-10	229	10	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	45.225	18.526	37.703	-6.056	195	441	64.946	42.049
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	101.970	78.592	61.535	26.727	1.413	511	171.357	-29.060
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	175.072	122.533	113.071	36.869	1.773	1.103	243.873	21.911
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	8.711	7.452	3.113	3.362	23	19	9.361	9.219
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	723	635	249	258	12	11	741	702
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	1.203	889	479	570	–	–	1.556	1.664
Rechtskosten	20	29	9	11	–	–	22	23
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	26	26	15	13	13	14	45	42
Druckkosten	20	25	8	10	–	–	26	27
Zinsaufwendungen	–	1	–	1	–	–	–	2
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	10	9	4	4	–	–	12	9
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	256	233	127	113	18	37	281	199
Aufwendungen gesamt	10.969	9.299	4.004	4.342	66	81	12.044	11.887
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-1	–	-95	-64	-32	-52	-1	–
Gesamtnettoaufwendungen	10.968	9.299	3.909	4.278	34	29	12.043	11.887
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	164.104	113.234	109.162	32.591	1.739	1.074	231.830	10.024
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-4.737	-5.284	-12.758	-14.041	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	159.367	107.950	96.404	18.550	1.739	1.074	231.830	10.024
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-3.791	-4.194	-2.059	-2.211	-20	-16	-1.809	-1.919
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 155.576	€ 103.756	\$ 94.345	\$ 16.339	\$ 1.719	\$ 1.058	\$ 230.021	\$ 8.105

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^*		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund*		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ 9.261	\$ 12.382	\$ 638	\$ 1.402	\$ 967	\$ 1.005	\$ 9.159	\$ 15.534	\$ 813	\$ 251
–	–	–	–	–	–	–	1	–	–
–	–	–	–	–	–	-4	-1	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
393.960	158.018	78.231	38.460	4.020	4.646	137.916	127.425	1.433	3.546
-296.879	82.019	-51.331	-21.219	-875	806	-31.483	-29.739	2.654	113
106.342	252.419	27.538	18.643	4.112	6.457	115.588	113.220	4.900	3.910
14.066	15.399	1.371	2.266	436	450	3.999	6.419	892	159
1.500	1.571	87	163	39	40	679	999	83	25
1.802	2.016	257	423	74	73	613	1.271	120	3
50	64	4	7	1	1	31	47	3	1
45	42	27	42	30	28	30	28	15	13
53	52	–	10	1	1	32	45	3	1
8	1	2	5	–	–	3	23	–	–
26	22	1	2	–	1	12	14	1	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
475	428	-37	113	44	54	236	302	35	29
18.025	19.595	1.712	3.031	625	648	5.635	9.148	1.152	231
-23	-21	-34	-38	-60	-65	-180	-217	-34	-33
18.002	19.574	1.678	2.993	565	583	5.455	8.931	1.118	198
88.340	232.845	25.860	15.650	3.547	5.874	110.133	104.289	3.782	3.712
–	-2	–	-3	-128	-135	-88	-113	–	–
88.340	232.843	25.860	15.647	3.419	5.739	110.045	104.176	3.782	3.712
-2.332	-3.116	-152	-269	-262	-272	-2.522	-3.983	-132	-41
\$ 86.008	\$ 229.727	\$ 25.708	\$ 15.378	\$ 3.157	\$ 5.467	\$ 107.523	\$ 100.193	\$ 3.650	\$ 3.671
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		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^	
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
\$ 1.082	\$ 1.309	\$ 65	\$ 89	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-2	2	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	26	142	–	–
2.929	8.786	33	-184	–	–	–	-1	–	–
15.420	-10.625	787	83	–	–	–	1	–	–
19.429	-528	885	-12	–	–	26	142	–	–
1.070	1.255	35	33	–	–	–	–	–	–
74	87	9	9	–	–	–	–	–	–
174	187	–	–	–	–	–	–	–	–
2	3	–	–	–	–	–	–	–	–
30	28	15	14	–	–	–	–	–	–
3	3	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1	1	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	26	142	–	–
48	64	24	30	–	–	–	–	–	–
1.402	1.628	83	86	–	–	26	142	–	–
-15	-14	-41	-46	–	–	–	–	–	–
1.387	1.614	42	40	–	–	26	142	–	–
18.042	-2.142	843	-52	–	–	–	–	–	–
-19	-25	–	–	–	–	–	–	–	–
18.023	-2.167	843	-52	–	–	–	–	–	–
-274	-301	-11	-8	–	–	–	–	–	–
\$ 17.749	\$ -2.468	\$ 832	\$ -60	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Legg Mason Batterymarch International Large Cap Fund ^Δ		Legg Mason Q5 Emerging Markets Equity Fund ^Δ		Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund ^Δ		Legg Mason Japan Equity Fund ^Δ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)								
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	3	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	–	–	–	–	–	3	–	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rechtskosten	–	–	–	–	–	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Druckkosten	–	–	–	–	–	–	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	3	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufwendungen gesamt	–	–	–	–	–	3	–	–
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gesamtnettoaufwendungen	–	–	–	–	–	3	–	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	–	–	–	–	–	–	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	–	–	–	–	–	–	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –

	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund ^Δ		FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund ^{Δ*}		FTGF Franklin European Unconstrained Fund ^{Δ*}		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{ΔΩ}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)								
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ –	\$ 383	\$ 565	\$ 680	€ 639	€ 1.712	\$ 95	\$ 96
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	3	–	1
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	1	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	-2.901	1.528	-2.865	1.296	-8.893	1.592	60
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	–	2.642	7.494	4.466	-8.793	-172	-466	469
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	1	124	9.587	2.281	-6.858	-7.350	1.221	626
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	–	71	230	309	67	427	3	9
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	–	7	27	32	19	107	11	14
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	–	22	7	13	3	8	1	4
Rechtskosten	–	6	1	1	3	6	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	–	11	14	14	11	19	12	21
Druckkosten	–	–	1	1	2	5	–	–
Zinsaufwendungen	–	–	1	–	3	1	–	2
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	–	–	–	–	–	1	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	1	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	–	31	60	58	19	47	-51	59
Aufwendungen gesamt	1	148	341	428	127	621	-24	109
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	–	-44	-67	-57	-32	-27	-14	-79
Gesamtnettoaufwendungen	1	104	274	371	95	594	-38	30
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	–	20	9.313	1.910	-6.953	-7.944	1.259	596
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	-174	–	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	–	-154	9.313	1.910	-6.953	-7.944	1.259	596
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	–	-17	-215	-85	-78	-108	-10	-12
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ -171	\$ 9.098	\$ 1.825	€ -7.031	€ -8.052	\$ 1.249	\$ 584

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

[illegible]

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^] λ		FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^] α		FTGF Putnam Balanced Fund [^] β		FTGF Putnam Global Healthcare Fund ^δ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)								
ANLAGEERTRÄGE:								
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 312	\$ –	\$ 4.658	\$ –	\$ 1.989	\$ –	\$ 39	\$ –
Zinsen (Erläuterung 2)	–	–	–	–	1	–	–	–
Ausgleich (Erläuterung 2)	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Erträge	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):								
Realisierter Nettogewinn/-verlust) aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	5.205	–	29.017	–	2.885	–	87	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	5.245	–	35.140	–	6.875	–	634	–
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	10.762	–	68.815	–	11.750	–	760	–
AUFWENDUNGEN:								
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	368	–	1.138	–	1.215	–	18	–
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	46	–	210	–	76	–	7	–
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	67	–	66	–	46	–	–	–
Rechtskosten	2	–	2	–	3	–	–	–
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	12	–	12	–	20	–	13	–
Druckkosten	2	–	2	–	2	–	1	–
Zinsaufwendungen	–	–	–	–	1	–	–	–
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	1	–	2	–	–	–	–	–
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	–	–	–	–	–	–	–	–
Sonstige Aufwendungen	25	–	81	–	44	–	36	–
Aufwendungen gesamt	523	–	1.513	–	1.407	–	75	–
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-25	–	-49	–	-17	–	-54	–
Gesamtnettoaufwendungen	498	–	1.464	–	1.390	–	21	–
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	10.264	–	67.351	–	10.360	–	739	–
FINANZIERUNGSKOSTEN:								
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	–	–	–	–	–	–	–	–
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	10.264	–	67.351	–	10.360	–	739	–
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-85	–	-1.171	–	-164	–	-9	–
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 10.179	\$ –	\$ 66.180	\$ –	\$ 10.196	\$ –	\$ 730	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

Gesamtergebnisrechnung – (Fortsetzung)

	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
(in Tsd.)		
ANLAGEERTRÄGE:		
Bruttodividendenerträge und Anleihezinsen (Erläuterung 2)	\$ 476.203	\$ 546.569
Zinsen (Erläuterung 2)	112	174
Ausgleich (Erläuterung 2)	-474	-843
Sonstige Erträge	576	163
Nettogewinn/-verlust aus ergebniswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (Erläuterung 2):		
Realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	959.351	403.503
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zu Handelszwecken gehaltenen Finanzinstrumenten	263.212	269.727
Gesamterträge/-verluste aus Anlagen	1.698.980	1.219.293
AUFWENDUNGEN:		
Anlageverwaltungsgebühren (Erläuterung 4)	91.532	99.756
Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren (Erläuterung 4)	11.211	11.662
Informationsstellengebühren (Erläuterung 4)	9.516	11.414
Rechtskosten	445	543
Prüfungsgebühren (Erläuterung 4)	1.291	1.175
Druckkosten	453	488
Zinsaufwendungen	166	171
Honorare und Auslagen der Verwaltungsratsmitglieder (Erläuterung 4)	187	170
Rückstellungen und sonstige Verbindlichkeiten – Anpassung	2.539	162
Sonstige Aufwendungen	5.078	4.976
Aufwendungen gesamt	122.418	130.517
Erläss/Erstattung/Rückerlangung von Spesen (Erläuterung 4)	-2.921	-1.736
Gesamtnettoaufwendungen	119.497	128.781
Nettogewinn/-verlust vor Finanzierungskosten	1.579.483	1.090.512
FINANZIERUNGSKOSTEN:		
Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile (Erläuterung 5)	-133.254	-153.422
Gewinn/Verlust für das Geschäftsjahr	1.446.229	937.090
Quellensteuerrückforderungen/Steuern auf Dividenden und sonstige Steuern	-25.226	-25.852
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.421.003	\$ 911.238

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

Gewinne und Verluste haben sich ausschließlich aus dem laufenden Geschäftsbetrieb ergeben, außer beim FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^α, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^α, FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^α, FTGF Franklin European Unconstrained Fund^α und FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α, die den Geschäftsbetrieb eingestellt haben. Es gab keine sonstigen Gewinne oder Verluste außer den in der Gesamtergebnisrechnung erfassten.

Die Euro-Beträge für den TGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^α, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^α, Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^α, FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund^α, Franklin Responsible Income 2028 Fund^α, Franklin Responsible Income 2029 Fund^α und FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund^α wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 zum durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,8674 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2025: 0,9315).

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

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

γ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^α den Handel auf.

δ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^α den Handel auf.

λ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^α den Handel auf.

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

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

Ω Mit Wirkung zum 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund^α den Handel ein.

η Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^α den Handel ein.

φ Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund^α den Handel ein.

μ Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 hat der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^α den Handel eingestellt.

ψ Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund^α den Handel auf.

π Am 7. Mai 2026 wurden die Genehmigungen für den FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund^α, den FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund^α und den FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund^α auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

* Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsamen und Verschmelzungen sind den Erläuterungen 14 und 16 zu entnehmen.

α In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Entwicklung des den Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnenden Nettovermögens

(in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 15.485	\$ 13.931	\$ 3.758	\$ 4.846	\$ 8.905	\$ 28.709	€ -	€ 331
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	3.470.155	3.361.280	2.990	21.329	12.915	166.248	-	761
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	49.952	46.926	879	1.182	635	956	-	5
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-3.148.582	-2.855.799	-27.227	-114.915	-94.484	-762.395	-	-50.926
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	371.525	552.407	-23.358	-92.404	-80.934	-595.191	-	-50.160
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	387.010	566.338	-19.600	-87.558	-72.029	-566.482	-	-49.829
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	1.680.756	1.114.418	97.902	185.460	248.773	815.255	-	49.829
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 2.067.766	\$ 1.680.756	\$ 78.302	\$ 97.902	\$ 176.744	\$ 248.773	€ -	€ -
(in Tsd.)	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^		FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 10.492	\$ 2.121
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	-	-	-	-	-	-	49.575	34.096
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	92	106
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-	-	-	-	-	-	-130.060	-93.992
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-	-	-	-	-	-	-80.393	-59.790
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	-	-	-	-	-	-	-69.901	-57.669
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	-	-	-	-	192.959	250.628
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 123.058	\$ 192.959
(in Tsd.)	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^	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 32.844	\$ 52.650	\$ 83.942	\$ 78.106	£ -	£ -	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	1.833	2.574	45.727	-	-	-	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	-	-	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-21.099	-66.178	-105.000	-7.427	-	-	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-19.266	-63.604	-59.273	-7.427	-	-	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	13.578	-10.954	24.669	70.679	-	-	-	-
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	515.202	526.156	1.220.387	1.149.708	-	-	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 528.780	\$ 515.202	\$ 1.245.056	\$ 1.220.387	£ -	£ -	\$ -	\$ -

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 [^]				FTGF Western Asset Global High Yield Fund			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	–	\$	–	\$	18.791	\$	2.774	\$	3.234	\$	4.804	\$	–	\$	–	\$	1.911	\$	1.349
	–		–		134.962		112.853		31.041		30.551		–		–		12.987		6.163
	–		–		397		467		939		2.110		–		–		260		269
	–		–		-208.037		-115.711		-42.491		-47.390		–		–		-17.188		-15.511
	–		–		-72.678		-2.391		-10.511		-14.729		–		–		-3.941		-9.079
	–		–		-53.887		383		-7.277		-9.925		–		–		-2.030		-7.730
	–		–		241.323		240.940		86.953		96.878		–		–		40.789		48.519
	–		–		–		–		–		–		–		–		–		–
\$	–	\$	–	\$	187.436	\$	241.323	\$	79.676	\$	86.953	\$	–	\$	–	\$	38.759	\$	40.789
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund				FTGF Western Asset Global Bond Fund ^{^*}				FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]				FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]				FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	13.408	\$	11.907	\$	8.100	\$	-932	\$	1.057	\$	1.906	\$	–	\$	-4.384	\$	46.474	\$	22.416
	44.250		70.014		2.225		1.102		11.810		794		–		64.975		35.564		65.037
	27		34		–		–		–		–		–		436		–		–
	-54.221		-381.830		-9.632		-32.259		-29.564		-6.571		–		-1.265.996		-151.424		-53.111
	-9.944		-311.782		-7.407		-31.157		-17.754		-5.777		–		-1.200.585		-115.860		11.926
	3.464		-299.875		693		-32.089		-16.697		-3.871		–		-1.204.969		-69.386		34.342
	178.663		478.538		97.331		129.420		27.126		30.997		–		1.204.969		407.023		372.681
	–		–		–		–		–		–		–		–		–		–
\$	182.127	\$	178.663	\$	98.024	\$	97.331	\$	10.429	\$	27.126	\$	–	\$	–	\$	337.637	\$	407.023
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion 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 [^]			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	308	\$	-285	\$	–	\$	–	\$	3.660	\$	-736	\$	11.509	\$	3.865	\$	2.519	\$	435
	551		210		–		–		7.001		74.656		420		517		27.422		19.636
	7		7		–		–		120		520		8		7		25		18
	-611		-11		–		–		-25.324		-158.371		-99.004		-16.626		-3.221		-8.166
	-53		206		–		–		-18.203		-83.195		-98.576		-16.102		24.226		11.488
	255		-79		–		–		-14.543		-83.931		-87.067		-12.237		26.745		11.923
	18.317		18.396		–		–		61.154		145.085		134.032		146.269		43.087		31.164
	–		–		–		–		–		–		–		–		–		–
\$	18.572	\$	18.317	\$	–	\$	–	\$	46.611	\$	61.154	\$	46.965	\$	134.032	\$	69.832	\$	43.087

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]		FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{^,η}		FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund ^{^,π}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 22.536	\$ -5.054	\$ 55.644	\$ -1.764	\$ -256	\$ 1.160	\$ -	\$ -
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	21.314	10.610	199.856	226.141	86	2.148	-	-
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	9	22	559	574	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-24.137	-33.449	-434.625	-461.247	-10.727	-8.814	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	-2.814	-22.817	-234.210	-234.532	-10.641	-6.666	-	-
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	19.722	-27.871	-178.566	-236.296	-10.897	-5.506	-	-
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	179.505	207.376	915.084	1.151.380	10.897	16.403	-	-
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 199.227	\$ 179.505	\$ 736.518	\$ 915.084	\$ -	\$ 10.897	\$ -	\$ -
(in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund ^{^,β}		FTGF ClearBridge US Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		FTGF Putnam US Research Fund [*]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 12.222	\$ -	\$ 88.736	\$ 178.842	\$ -	\$ -	\$ 87.785	\$ 27.095
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	57.968	-	435.249	967.907	-	-	1.357.456	14.272
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	-	-	1	1	-	-	-	2
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-788	-	-1.116.450	-1.089.007	-	-	-154.131	-71.065
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	57.180	-	-681.200	-121.099	-	-	1.203.325	-56.791
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	69.402	-	-592.464	57.743	-	-	1.291.110	-29.696
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	-	-	1.215.369	1.157.626	-	-	181.760	211.456
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	\$ 69.402	\$ -	\$ 622.905	\$ 1.215.369	\$ -	\$ -	\$ 1.472.870	\$ 181.760
(in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund ^{^*}		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	€ 155.576	€ 103.756	\$ 94.345	\$ 16.339	\$ 1.719	\$ 1.058	\$ 230.021	\$ 8.105
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	562.970	274.946	194.391	94.130	35	-	456.117	765.250
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	5	24	1.557	1.898	-	-	-	-
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-213.612	-467.478	-159.351	-157.027	-	-	-582.812	-483.911
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	349.363	-192.508	36.597	-60.999	35	-	-126.695	281.339
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	504.939	-88.752	130.942	-44.660	1.754	1.058	103.326	289.444
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	734.171	822.923	287.149	331.809	6.699	5.641	984.334	694.890
Währungsumrechnung	-	-	-	-	-	-	-	-
Zum Jahresende	€ 1.239.110	€ 734.171	\$ 418.091	\$ 287.149	\$ 8.453	\$ 6.699	\$ 1.087.660	\$ 984.334

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund [^]				FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]				FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]				FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]				FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] _π			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	–	\$	–	\$	–	\$	667	\$	–	\$	428	\$	2.066	\$	1.818	\$	–	\$	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	700	3.300	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	-71.704	–	–	–	-16.257	-4.305	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	-71.704	–	–	–	-16.257	-3.605	3.300	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	-71.037	–	–	–	-15.829	-1.539	5.118	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	71.037	–	–	–	15.829	36.817	31.699	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	35.278	\$	36.817	\$	–	\$	–
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund				FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund [^] *				FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund*				FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund				FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	86.008	\$	229.727	\$	25.708	\$	15.378	\$	3.157	\$	5.467	\$	107.523	\$	100.193	\$	3.650	\$	3.671
357.147	605.213	2.962	11.463	756	3.831	383.962	479.862	201.722	12.093	–	2	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-1.043.582	-707.561	-205.399	-57.502	-5.475	-4.806	-784.425	-1.024.209	-38.448	-5.153	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-686.435	-102.346	-202.437	-46.039	-4.709	-967	-400.463	-544.347	163.274	6.940	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-600.427	127.381	-176.729	-30.661	-1.552	4.500	-292.940	-444.154	166.924	10.611	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
1.999.981	1.872.600	176.729	207.390	40.436	35.936	921.356	1.365.510	27.329	16.718	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$	1.399.554	\$	1.999.981	\$	–	\$	176.729	\$	38.884	\$	40.436	\$	628.416	\$	921.356	\$	194.253	\$	27.329
FTGF Royce US Smaller Companies Fund				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 [^]			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026		für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	
\$	17.749	\$	-2.468	\$	832	\$	-60	\$	–	\$	–	€	–	€	–	\$	–	\$	–
12.531	18.608	43	7	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-23.511	-29.222	-27	-11	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
-10.980	-10.614	16	-4	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
6.769	-13.082	848	-64	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
82.853	95.935	4.322	4.386	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
\$	89.622	\$	82.853	\$	5.170	\$	4.322	\$	–	\$	–	€	–	€	–	\$	–	\$	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

(in Tsd.)	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 [^]	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	–	–	–	–	–	–	–
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	–	–	–	–	–	–	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –
(in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]		FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund ^{^*}		FTGF Franklin European Unconstrained Fund ^{^φ*}		FTGF Martin Currie Improving Society Fund ^{^Ω}	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ –	\$ -171	\$ 9.098	\$ 1.825	€ -7.031	€ -8.052	\$ 1.249	\$ 584
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	–	19	5.452	5.418	114	15.381	400	15.876
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	–	-20.992	-26.222	-6.937	-76.100	-113.190	-17.185	-7.110
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	-20.973	-20.770	-1.519	-75.986	-97.809	-16.785	8.766
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	–	-21.144	-11.672	306	-83.017	-105.861	-15.536	9.350
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	–	21.144	31.953	31.647	83.017	188.878	15.536	6.186
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ –	\$ –	\$ 20.281	\$ 31.953	€ –	€ 83.017	\$ –	\$ 15.536
(in Tsd.)	FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund ^{^λ}		FTGF Putnam US Large Cap Value Fund ^{^u}		FTGF Putnam Balanced Fund ^{^b}		FTGF Putnam Global Healthcare Fund ^θ	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 10.179	\$ –	\$ 66.180	\$ –	\$ 10.196	\$ –	\$ 730	\$ –
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN								
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	68.169	–	858.724	–	229.383	–	3.199	–
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	–	–	–	–	–	–	–	–
Kosten für zurückgekaufte Anteile	-4.902	–	-407.874	–	-19.135	–	–	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	63.267	–	450.850	–	210.248	–	3.199	–
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	73.446	–	517.030	–	220.444	–	3.929	–
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN								
Zu Jahresbeginn	–	–	–	–	–	–	–	–
Währungsumrechnung	–	–	–	–	–	–	–	–
Zum Jahresende	\$ 73.446	\$ –	\$ 517.030	\$ –	\$ 220.444	\$ –	\$ 3.929	\$ –

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]				Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]				Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]				Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]				FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund ^{^*μ}			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		
\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	1.581	\$	-2.326
	-		-		-		-		-		-		-		-		106		11.144
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-23.183		-111.343
	-		-		-		-		-		-		-		-		-23.077		-100.199
	-		-		-		-		-		-		-		-		-21.496		-102.525
	-		-		-		-		-		-		-		-		21.496		124.021
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	-	\$	21.496
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]				Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]				FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund ^{^ψ}				FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund ^{^γ}				FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund ^{^δ}			
für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025			für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025		
€	-754	€	1.727	€	257	€	2.111	€	3	€	-	\$	41.822	\$	-	\$	3.333	\$	-
	-		-		-		73.659		5.000		-		2.521.785		-		40.144		-
	-		-		-		-		-		-		547		-		-		-
	-11.346		-6.480		-2.183		-36.624		-		-		-1.021.598		-		-11.342		-
	-11.346		-6.480		-2.183		37.035		5.000		-		1.500.734		-		28.802		-
	-12.100		-4.753		-1.926		39.146		5.003		-		1.542.556		-		32.135		-
	82.951		87.704		39.146		-		-		-		-		-		-		-
	-		-		-		-		-		-		-		-		-		-
€	70.851	€	82.951	€	37.220	€	39.146	€	5.003	€	-	\$	1.542.556	\$	-	\$	32.135	\$	-

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

(in Tsd.)	Franklin Templeton Global Funds Plc	
	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026	für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
Nettozunahme/-abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile aus dem operativen Geschäft zuzurechnen ist	\$ 1.421.003	\$ 911.238
TRANSAKTIONEN MIT RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN		
Nettoerlöse aus dem Verkauf von Anteilen	11.956.424	7.671.093
Nettoerlöse aus wiederangelegten Ausschüttungen	56.030	55.576
Kosten für zurückgekauften Anteile	-10.636.621	-11.090.240
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens aus Transaktionen mit rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1.375.833	-3.363.571
Zunahme/Abnahme des Nettovermögens, das Inhabern rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile zuzurechnen ist	2.796.836	-2.452.333
DEN INHABERN VON RÜCKKAUFBAREN GEWINNBERECHTIGTEN ANTEILEN ZUZURECHNENDES NETTOVERMÖGEN		
Zu Jahresbeginn	13.405.749	15.900.307
Währungsumrechnung	147.055	-42.225
Zum Jahresende	\$ 16.349.640	\$ 13.405.749

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

Alle Euro-Beträge, außer des Anfang des Berichtsjahres den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnenden Nettovermögens, für den FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] und FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] wurden zur Berechnung des Gesamtbetrags für Franklin Templeton Global Funds Plc für das Berichtsjahr zum 28. Februar 2026 zum durchschnittlichen USD/EUR-Kurs von 0,8674 in US-Dollar umgerechnet (28. Februar 2025: 0,9315).

Das den Inhabern von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen zuzurechnende Nettovermögen zu Beginn des Berichtsjahres für die oben genannten, auf EUR lautenden Fonds wurde zur Berechnung der Gesamtbeträge zum 28. Februar 2025 zum USD/EUR-Schlusskurs von 0,9640 in US-Dollar umgerechnet (29. Februar 2024: 0,9252).

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

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

γ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^] den Handel auf.

δ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^] den Handel auf.

λ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^] den Handel auf.

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

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

Ω Mit Wirkung vom 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel ein.

η Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] den Handel ein.

φ Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 stellte der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

Ψ Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] den Handel auf.

π Am 7. Mai 2026 wurden die Genehmigungen für den FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], den FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und den FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

* Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsamen und Verschmelzungen sind den Erläuterungen 14 und 16 zu entnehmen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	5.711	5.955
Zurückgenommen	-5.952	-4.764
Nettozunahme/-abnahme	-241	1.191
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1.902.341	1.739.070
Zurückgenommen	-1.529.774	-1.386.634
Nettozunahme	372.567	352.436
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-174
Nettoabnahme	–	-174
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	929.394	1.005.311
Zurückgenommen	-898.756	-947.677
Nettozunahme	30.638	57.634
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	5	7
Zurückgenommen	-3	-27
Nettozunahme/-abnahme	2	-20
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	8	41
Zurückgenommen	-75	-68
Nettoabnahme	-67	-27
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	23	260
Zurückgenommen	-43	-361
Nettoabnahme	-20	-101
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-16	-11
Nettoabnahme	-15	-7
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-3	-3
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-2	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	4	33
Zurückgenommen	-61	-588
Nettoabnahme	-57	-555
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	32
Zurückgenommen	-36	-107
Nettoabnahme	-32	-75
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	6	15
Zurückgenommen	-3	-26
Nettozunahme/-abnahme	3	-11
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	145
Zurückgenommen	–	-145
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-37
Nettoabnahme	–	-36
Klasse GA USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse GE USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	25	57
Zurückgenommen	-188	-331
Nettoabnahme	-163	-274
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	46	63
Zurückgenommen	-71	-100
Nettoabnahme	-25	-37
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-3	-12
Nettoabnahme	-2	-9
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-3	-10
Nettozunahme/-abnahme	1	-9
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	2	11
Zurückgenommen	-31	-62
Nettoabnahme	-29	-51
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	9	2
Zurückgenommen	-13	-18
Nettoabnahme	-4	-16
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	9	5
Zurückgenommen	-41	-53
Nettoabnahme	-32	-48
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	47	532
Zurückgenommen	-209	-3.543
Nettoabnahme	-162	-3.011
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	23	32
Zurückgenommen	-37	-50
Nettoabnahme	-14	-18
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-11
Nettoabnahme	–	-8
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-24	-14
Nettoabnahme	-22	-14
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	12	655
Zurückgenommen	-161	-1.676
Nettoabnahme	-149	-1.021
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	94
Zurückgenommen	–	-139
Nettoabnahme	–	-45
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	–	748
Zurückgenommen	–	-748
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	28
Zurückgenommen	–	-163
Nettoabnahme	–	-135

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse B (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund^		
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-13
Nettoabnahme	–	-13
Klasse A EUR Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-9
Nettoabnahme	–	-9
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	–	-62
Nettoabnahme	–	-54
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-419
Nettoabnahme	–	-419
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-4
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse GE EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	10	15
Zurückgenommen	-22	-17
Nettoabnahme	-12	-2
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	9	9
Zurückgenommen	-18	-14
Nettoabnahme	-9	-5
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	41	33
Zurückgenommen	-34	-17
Nettozunahme	7	16
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	5	3
Zurückgenommen	-8	-5
Nettoabnahme	-3	-2
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	4	9
Zurückgenommen	-3	-7
Nettozunahme	1	2

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-5
Nettoabnahme	-1	-5
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-2	-6
Nettoabnahme	-2	-3
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	-4	–
Nettoabnahme	-4	–
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	190	352
Zurückgenommen	-384	-671
Nettoabnahme	-194	-319
Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	3.498	2.441
Zurückgenommen	-3.756	-1.911
Nettozunahme/-abnahme	-258	530
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-2	-10
Nettoabnahme	-2	-7
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	7	4
Zurückgenommen	-22	-15
Nettoabnahme	-15	-11
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	1	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	23	31
Zurückgenommen	-16	-24
Nettozunahme	7	7
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-5	-2
Nettoabnahme	-5	-1
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-5
Nettoabnahme	-1	-4
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	19	4
Zurückgenommen	-8	–
Nettozunahme	11	4
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	15
Zurückgenommen	-85	-18
Nettoabnahme	-85	-3
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	522
Zurückgenommen	–	-522
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	158
Zurückgenommen	-15	-167
Nettoabnahme	-15	-9
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	102
Zurückgenommen	-2	-100
Nettozunahme/-abnahme	-2	2
Klasse LM AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	6	50
Zurückgenommen	-774	-336
Nettoabnahme	-768	-286
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	12	61
Zurückgenommen	-30	-65
Nettoabnahme	-18	-4
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	26	60
Zurückgenommen	-70	-86
Nettoabnahme	-44	-26
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	97	49
Zurückgenommen	-39	-40
Nettozunahme	58	9
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	19	7
Zurückgenommen	-6	-5
Nettozunahme	13	2
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	52	16
Zurückgenommen	-46	-4
Nettozunahme	6	12
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	33.519	9.956
Zurückgenommen	-22.707	-4.883
Nettozunahme	10.812	5.073

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	–	-5
Nettozunahme/-abnahme	1	-4
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	12
Zurückgenommen	-2	-3
Nettozunahme	2	9
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	2	6
Zurückgenommen	-2	-9
Nettoabnahme	–	-3
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	11	1
Zurückgenommen	-2	-1
Nettozunahme	9	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-1	-3
Nettoabnahme	–	-2
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	11	49
Zurückgenommen	-46	-78
Nettoabnahme	-35	-29
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	4	16
Zurückgenommen	-100	-127
Nettoabnahme	-96	-111
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-4	-1
Nettoabnahme	-2	–
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-3
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse GF USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	17	11
Zurückgenommen	-24	-8
Nettozunahme/-abnahme	-7	3
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	16	4
Zurückgenommen	-28	-10
Nettoabnahme	-12	-6
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	19	10
Zurückgenommen	-30	-18
Nettoabnahme	-11	-8

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	24	27
Zurückgenommen	-23	-41
Nettozunahme/-abnahme	1	-14
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	31	43
Zurückgenommen	-43	-54
Nettoabnahme	-12	-11
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	5	–
Zurückgenommen	-9	-2
Nettoabnahme	-4	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	12.512	3.107
Zurückgenommen	-9.133	-3.851
Nettozunahme/-abnahme	3.379	-744
Klasse B USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	8	3
Zurückgenommen	-2	-2
Nettozunahme	6	1
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1	11
Zurückgenommen	-10	-40
Nettoabnahme	-9	-29
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-4	-39
Nettoabnahme	-3	-36
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-2	-7
Nettoabnahme	-2	-5
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-1

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	15	27
Zurückgenommen	-41	-67
Nettoabnahme	-26	-40
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	18	4
Zurückgenommen	-5	-7
Nettozunahme/-abnahme	13	-3
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	86	57
Zurückgenommen	-162	-106
Nettoabnahme	-76	-49
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	1	6
Zurückgenommen	-6	-19
Nettoabnahme	-5	-13
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	51	108
Zurückgenommen	-96	-157
Nettoabnahme	-45	-49
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	858	2.151
Zurückgenommen	-2.782	-1.401
Nettozunahme/-abnahme	-1.924	750
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	155	3
Zurückgenommen	-158	-6
Nettoabnahme	-3	-3
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-2	-3
Nettoabnahme	-2	-2
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	257	53
Zurückgenommen	-382	-102
Nettoabnahme	-125	-49
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	257	56
Zurückgenommen	-502	-46
Nettozunahme/-abnahme	-245	10
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	2.653	352
Zurückgenommen	-1.838	-919
Nettozunahme/-abnahme	815	-567
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	14	14
Zurückgenommen	-16	-441
Nettoabnahme	-2	-427
Klasse B USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-3
Nettoabnahme	-1	-3
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)		
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	13	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	12	-2
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	46	19
Zurückgenommen	-228	-75
Nettoabnahme	-182	-56
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	12
Zurückgenommen	-26	-18
Nettoabnahme	-26	-6
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	13
Zurückgenommen	–	-175
Nettoabnahme	–	-162
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	21
Zurückgenommen	–	-73
Nettoabnahme	–	-52
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse LM USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-66	-17
Nettoabnahme	-66	-17
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-20
Nettoabnahme	–	-20
Klasse LM EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	33	–
Zurückgenommen	-33	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	75	84
Zurückgenommen	-89	-114
Nettoabnahme	-14	-30
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	6	5
Zurückgenommen	-13	-10
Nettoabnahme	-7	-5
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	26
Zurückgenommen	-39	-122
Nettoabnahme	-37	-96
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	23	151
Zurückgenommen	-318	-710
Nettoabnahme	-295	-559
Klasse A SEK ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	3	4
Zurückgenommen	-7	-11
Nettoabnahme	-4	-7
Klasse C USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-36
Nettoabnahme	-1	-36
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	2	6
Zurückgenommen	-3	-16
Nettoabnahme	-1	-10
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	–	-17
Nettozunahme/-abnahme	1	-15
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-2
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	21
Zurückgenommen	-6	-215
Nettoabnahme	-3	-194
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	137	78
Zurückgenommen	-22	-100
Nettozunahme/-abnahme	115	-22
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	40
Zurückgenommen	–	-42
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	51
Zurückgenommen	–	-166
Nettoabnahme	–	-115
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-2
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	300	92
Zurückgenommen	-294	-394
Nettozunahme/-abnahme	6	-302
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	50	31
Zurückgenommen	-54	-113
Nettoabnahme	-4	-82
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	419	1.291
Zurückgenommen	-548	-3.038
Nettoabnahme	-129	-1.747
FTGF Western Asset Global Bond Fund^*		
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-11	-3
Nettoabnahme	-11	-1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Bond Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	14	11
Zurückgenommen	-54	-25
Nettoabnahme	-40	-14
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-205
Nettoabnahme	–	-205
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-40
Nettoabnahme	–	-40
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-38
Nettoabnahme	–	-36
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	-8
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	61	1
Zurückgenommen	-133	-33
Nettoabnahme	-72	-32
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	7	6
Zurückgenommen	-60	-1
Nettozunahme/-abnahme	-53	5
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	152
Zurückgenommen	–	-2.144
Nettoabnahme	–	-1.992
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	93
Zurückgenommen	–	-1.421
Nettoabnahme	–	-1.328
Klasse A USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	19
Zurückgenommen	–	-272
Nettoabnahme	–	-253
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-25
Nettoabnahme	–	-25
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	20
Zurückgenommen	–	-279
Nettoabnahme	–	-259
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-36
Nettoabnahme	–	-35
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	–	-58
Nettoabnahme	–	-51

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-134
Nettoabnahme	–	-134
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	64
Zurückgenommen	–	-1.693
Nettoabnahme	–	-1.629
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-44
Nettoabnahme	–	-41
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-56
Nettoabnahme	–	-56
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	54
Zurückgenommen	–	-122
Nettoabnahme	–	-68
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-26
Nettoabnahme	–	-26
Klasse A GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-83
Nettoabnahme	–	-82
Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A NOK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	860
Zurückgenommen	–	-1.392
Nettoabnahme	–	-532
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	–	-110
Nettoabnahme	–	-105
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	611
Zurückgenommen	–	-8.416
Nettoabnahme	–	-7.805
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	864
Zurückgenommen	–	-34.102
Nettoabnahme	–	-33.238
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-50
Nettoabnahme	–	-50
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	–	-276
Nettoabnahme	–	-271
Klasse C USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-46
Nettoabnahme	–	-43
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-95
Nettoabnahme	–	-94
Klasse E USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-11
Nettoabnahme	–	-11
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-27
Nettoabnahme	–	-25
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	–	6
Zurückgenommen	–	-289
Nettoabnahme	–	-283

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse F USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	–	-40
Nettoabnahme	–	-33
Klasse R EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	140
Zurückgenommen	–	-140
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	43
Zurückgenommen	–	-479
Nettoabnahme	–	-436
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-37
Nettoabnahme	–	-37
Klasse X USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	10
Zurückgenommen	–	-97
Nettoabnahme	–	-87
Klasse X CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-73
Nettoabnahme	–	-72
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	165
Zurückgenommen	–	-591
Nettoabnahme	–	-426
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-12
Nettoabnahme	–	-11
Klasse X EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-38
Nettoabnahme	–	-38
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-6
Nettoabnahme	–	-6
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	6
Zurückgenommen	–	-161
Nettoabnahme	–	-155
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	–	-19
Nettoabnahme	–	-14
Klasse X SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-2.410
Nettoabnahme	–	-2.410
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	13
Zurückgenommen	–	-355
Nettoabnahme	–	-342
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	50
Zurückgenommen	–	-207
Nettoabnahme	–	-157
Klasse Premier AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-13
Nettoabnahme	–	-13
Klasse Premier AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	-21
Nettoabnahme	–	-17
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	15
Zurückgenommen	–	-809
Nettoabnahme	–	-794

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	–	-38
Nettoabnahme	–	-31
Klasse Premier CHF Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	90
Zurückgenommen	–	-103
Nettoabnahme	–	-13
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	12
Zurückgenommen	–	-806
Nettoabnahme	–	-794
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-87
Nettoabnahme	–	-86
Klasse Premier EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	94
Zurückgenommen	–	-416
Nettoabnahme	–	-322
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-30
Nettoabnahme	–	-29
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	10
Zurückgenommen	–	-197
Nettoabnahme	–	-187
Klasse Premier JPY Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-712
Nettoabnahme	–	-712
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	106
Zurückgenommen	–	-180
Nettoabnahme	–	-74
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-20
Nettoabnahme	–	-20
Klasse LM AUD Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	15
Zurückgenommen	–	-191
Nettoabnahme	–	-176
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-12	-5
Nettoabnahme	-12	-2
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	14
Zurückgenommen	-93	-4
Nettozunahme/-abnahme	-84	10

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	86	85
Zurückgenommen	-40	-31
Nettozunahme	46	54
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	372
Nettozunahme	–	372
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	4
Zurückgenommen	-4	-6
Nettozunahme/-abnahme	5	-2
Klasse LM EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	14
Zurückgenommen	-327	-84
Nettoabnahme	-327	-70
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	109	588
Zurückgenommen	-505	-658
Nettoabnahme	-396	-70
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
Klasse D USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-5	-7
Nettoabnahme	-5	-7
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse D USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	9
Zurückgenommen	–	-4
Nettozunahme	–	5
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse M USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-1	-1
Nettozunahme	1	1
Klasse M EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	2	8
Zurückgenommen	-92	-408
Nettoabnahme	-90	-400
Klasse Premier USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	20	11
Zurückgenommen	-77	-64
Nettoabnahme	-57	-53
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3.021
Zurückgenommen	–	-3.023
Nettoabnahme	–	-2
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	75	–
Zurückgenommen	–	-70
Nettozunahme/-abnahme	75	-70
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	327	10.625
Zurückgenommen	-968	-10.625
Nettoabnahme	-641	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	8	3
Zurückgenommen	-9	–
Nettozunahme/-abnahme	-1	3
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	9	19
Zurückgenommen	-15	-34
Nettoabnahme	-6	-15
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	6	5
Zurückgenommen	-10	-5
Nettoabnahme	-4	–
Klasse A USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	4	19
Zurückgenommen	-14	-107
Nettoabnahme	-10	-88
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	-9	–
Nettozunahme/-abnahme	-9	8
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-99
Nettoabnahme	–	-96
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	8	166
Zurückgenommen	-48	-54
Nettozunahme/-abnahme	-40	112
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-56
Nettoabnahme	–	-54
Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	14	44
Zurückgenommen	-21	-6
Nettozunahme/-abnahme	-7	38
Klasse A EUR Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-25
Nettoabnahme	–	-23
Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	1	21
Zurückgenommen	-3	-5
Nettozunahme/-abnahme	-2	16
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	2	22
Zurückgenommen	-12	-100
Nettoabnahme	-10	-78
Klasse B USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse C USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-4
Nettoabnahme	-1	-4
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	4
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	3	84
Zurückgenommen	-86	-3
Nettozunahme/-abnahme	-83	81
Klasse F USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	-26
Nettoabnahme	–	-26
Klasse X USD Ausschüttend (S)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	–	-8
Nettoabnahme	–	-8
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	40	2
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	39	2
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	9
Zurückgenommen	-10	-32
Nettoabnahme	-9	-23
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	2	15
Zurückgenommen	-22	-66
Nettoabnahme	-20	-51
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	-43
Nettoabnahme	–	-39
Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	15	62
Zurückgenommen	-36	-37
Nettozunahme/-abnahme	-21	25
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	6
Zurückgenommen	-6	-194
Nettoabnahme	-6	-188
Klasse Premier USD Ausschüttend (S)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-55
Nettoabnahme	–	-54

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	62
Zurückgenommen	-15	-61
Nettozunahme/-abnahme	-6	1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-9	-8
Nettoabnahme	-9	-7
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme/-abnahme	-1	1
Klasse LM USD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	18
Zurückgenommen	–	-308
Nettoabnahme	–	-290
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	3	339
Zurückgenommen	-5	-327
Nettozunahme/-abnahme	-2	12
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-2	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse F USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-21	–
Nettoabnahme	-21	–
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	1	24
Zurückgenommen	-742	-54
Nettoabnahme	-741	-30
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-21	-5
Nettoabnahme	-21	-4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^] – (Fortsetzung)		
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-128
Nettoabnahme	–	-126
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	183	30
Zurückgenommen	-42	-5
Nettozunahme	141	25
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	44	71
Zurückgenommen	-9	-5
Nettozunahme	35	66
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	8	16
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	8	15
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-41
Nettoabnahme	–	-41
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	1	10
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	–	10
Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	61
Zurückgenommen	–	-6
Nettozunahme	–	55
Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	9	1
Zurückgenommen	-6	-18
Nettozunahme/-abnahme	3	-17
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-3
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	356	18
Zurückgenommen	-373	-19
Nettoabnahme	-17	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-3	–
Nettozunahme/-abnahme	-3	3
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	4	–
Zurückgenommen	-4	-15
Nettoabnahme	–	-15

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse F USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	2
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-9
Nettoabnahme	–	-7
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	4	1
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	3	1
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	158	1.087
Zurückgenommen	-189	-1.233
Nettoabnahme	-31	-146
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-17
Nettoabnahme	–	-17
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-14
Nettoabnahme	–	-14
Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)		
Verkauft	11	14
Zurückgenommen	-5	-4
Nettozunahme	6	10
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	102	367
Zurückgenommen	-560	-693
Nettoabnahme	-458	-326
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-12
Nettoabnahme	–	-11
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	40	44
Zurückgenommen	-31	-92
Nettozunahme/-abnahme	9	-48
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	74	158
Zurückgenommen	-331	-339
Nettoabnahme	-257	-181
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	122	56
Zurückgenommen	-110	-135
Nettozunahme/-abnahme	12	-79
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5	–
Zurückgenommen	-5	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-5	-11
Nettoabnahme	-3	-11
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	11	56
Zurückgenommen	-82	-7
Nettozunahme/-abnahme	-71	49
Klasse A CZK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	6	11
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	6	10
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	20	57
Zurückgenommen	-160	-206
Nettoabnahme	-140	-149
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)		
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	4	11
Zurückgenommen	-46	-74
Nettoabnahme	-42	-63
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	62	108
Zurückgenommen	-123	-154
Nettoabnahme	-61	-46
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	5	1
Zurückgenommen	-2	-7
Nettozunahme/-abnahme	3	-6
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	7	9
Zurückgenommen	-16	-30
Nettoabnahme	-9	-21
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	11	–
Zurückgenommen	-4	-6
Nettozunahme/-abnahme	7	-6
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	1	13
Zurückgenommen	-7	-16
Nettoabnahme	-6	-3
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	160	118
Zurückgenommen	-251	-245
Nettoabnahme	-91	-127
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	7.972	12.837
Zurückgenommen	-10.795	-15.440
Nettoabnahme	-2.823	-2.603
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	4.029	4.938
Zurückgenommen	-11.202	-19.251
Nettoabnahme	-7.173	-14.313
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	524	518
Zurückgenommen	-625	-2.497
Nettoabnahme	-101	-1.979
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	10	39
Zurückgenommen	-32	-128
Nettoabnahme	-22	-89
Klasse C USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	16	23
Zurückgenommen	-42	-29
Nettoabnahme	-26	-6
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	10	76
Zurückgenommen	-90	-235
Nettoabnahme	-80	-159
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	4	3
Zurückgenommen	-10	-3
Nettoabnahme	-6	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	9
Zurückgenommen	-15	-15
Nettoabnahme	-12	-6
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	16	37
Zurückgenommen	-52	-110
Nettoabnahme	-36	-73
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	9	15
Zurückgenommen	-24	-35
Nettoabnahme	-15	-20
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	19	44
Zurückgenommen	-2	-33
Nettozunahme	17	11

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse X USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	18	12
Zurückgenommen	-42	-22
Nettoabnahme	-24	-10
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	10
Zurückgenommen	-1	-94
Nettoabnahme	–	-84
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	20	4
Zurückgenommen	-13	-3
Nettozunahme	7	1
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	2	7
Zurückgenommen	-9	-138
Nettoabnahme	-7	-131
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-6	-17
Nettoabnahme	-5	-13
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	51	157
Zurückgenommen	-491	-190
Nettoabnahme	-440	-33
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	50
Zurückgenommen	-2	-135
Nettoabnahme	-2	-85
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-7
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	48	104
Zurückgenommen	-216	-322
Nettoabnahme	-168	-218
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	6	73
Zurückgenommen	-2	-350
Nettozunahme/-abnahme	4	-277
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	–	-8
Nettozunahme/-abnahme	3	-8
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	1.003	126
Zurückgenommen	-385	-166
Nettozunahme/-abnahme	618	-40
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	–	26
Zurückgenommen	–	-1
Nettozunahme	–	25
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	39
Zurückgenommen	-1	-304
Nettoabnahme	-1	-265
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	2	3
Zurückgenommen	-7	-11
Nettoabnahme	-5	-8
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)		
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	213	83
Zurückgenommen	-65	-1
Nettozunahme	148	82
Klasse LM USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	23	45
Zurückgenommen	-14	-22
Nettozunahme	9	23
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	67	795
Zurückgenommen	-1.317	-462
Nettozunahme/-abnahme	-1.250	333
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	449
Zurückgenommen	-81	-552
Nettoabnahme	-80	-103
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]η		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	1	16
Zurückgenommen	-18	-2
Nettozunahme/-abnahme	-17	14
Klasse X USD Ausschüttend (M)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	20
Zurückgenommen	-67	-53
Nettoabnahme	-67	-33
Klasse LM USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-30
Nettoabnahme	–	-30
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-120
Nettoabnahme	–	-120
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1.223
Nettoabnahme	–	-1.223
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-148
Nettoabnahme	–	-148
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	6	31
Zurückgenommen	-37	–
Nettozunahme/-abnahme	-31	31
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]β		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM NZD Thesaurierend		
Verkauft	970	–
Zurückgenommen	-12	–
Nettozunahme	958	–
FTGF ClearBridge US Value Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	83	198
Zurückgenommen	-278	-300
Nettoabnahme	-195	-102
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	12	18
Zurückgenommen	-26	-21
Nettoabnahme	-14	-3
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	10
Zurückgenommen	-6	-4
Nettozunahme/-abnahme	-4	6
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	25	94
Zurückgenommen	-51	-90
Nettozunahme/-abnahme	-26	4
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	134	227
Zurückgenommen	-273	-303
Nettoabnahme	-139	-76
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	181	1.353
Zurückgenommen	-2.593	-1.641
Nettoabnahme	-2.412	-288
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	19	29
Zurückgenommen	-24	-13
Nettozunahme/-abnahme	-5	16
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-2	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	8	39
Zurückgenommen	-41	-10
Nettozunahme/-abnahme	-33	29
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	9	24
Zurückgenommen	-32	-18
Nettozunahme/-abnahme	-23	6
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	2	28
Zurückgenommen	-8	-17
Nettozunahme/-abnahme	-6	11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Value Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	7	37
Zurückgenommen	-27	-19
Nettozunahme/-abnahme	-20	18
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	55	1.334
Zurückgenommen	-1.242	-128
Nettozunahme/-abnahme	-1.187	1.206
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	194	418
Zurückgenommen	-980	-1.122
Nettoabnahme	-786	-704
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-1	-2
Nettozunahme	–	1
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	228	752
Zurückgenommen	-566	-1.230
Nettoabnahme	-338	-478
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	69	249
Zurückgenommen	-298	-250
Nettoabnahme	-229	-1
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	2.032	2.753
Zurückgenommen	-1.638	-2.632
Nettozunahme	394	121
Klasse S GBP Thesaurierend		
Verkauft	24	–
Nettozunahme	24	–
LM Klasse USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	9	19
Zurückgenommen	-28	-26
Nettoabnahme	-19	-7
FTGF Putnam US Research Fund*		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	34	27
Zurückgenommen	-24	-36
Nettozunahme/-abnahme	10	-9
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	2	–
Zurückgenommen	-3	-15
Nettoabnahme	-1	-15
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	8	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	8	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	15	–
Zurückgenommen	-3	-3
Nettozunahme/-abnahme	12	-3
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse AX AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	1	–
Klasse AX CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse AX EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	–
Nettozunahme	4	–
Klasse AX GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse AX HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse AX SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse AX USD Thesaurierend		
Verkauft	14	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	14	–
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	3	7
Zurückgenommen	-5	-8
Nettoabnahme	-2	-1
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-6	-4
Nettoabnahme	-6	-4
Klasse D1 HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse D1 USD Thesaurierend		
Verkauft	299	–
Zurückgenommen	-9	–
Nettozunahme	290	–
Klasse D2 HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D2 SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse D2 USD Thesaurierend		
Verkauft	32	–
Zurückgenommen	-4	–
Nettozunahme	28	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	18	5
Zurückgenommen	-18	-10
Nettoabnahme	–	-5
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	10	5
Zurückgenommen	-9	-13
Nettozunahme/-abnahme	1	-8
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-1	-5
Nettoabnahme	–	-3
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	8	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	7	–
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	88	6
Zurückgenommen	-23	-4
Nettozunahme	65	2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Putnam US Research Fund* – (Fortsetzung)		
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-1	-4
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	106	–
Zurückgenommen	-2	-46
Nettozunahme/-abnahme	104	-46
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse 5 GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	3.784	–
Zurückgenommen	-406	–
Nettozunahme	3.378	–
Klasse P1 AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P1 CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	9	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	9	–
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	147	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	142	–
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	55	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	55	–
Klasse P1 HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	2.602	–
Zurückgenommen	-542	–
Nettozunahme	2.060	–
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	977	–
Zurückgenommen	-73	–
Nettozunahme	904	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	1.477	–
Zurückgenommen	-89	–
Nettozunahme	1.388	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	59	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	57	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	10	–
Zurückgenommen	-22	-27
Nettoabnahme	-12	-27

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GA USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GE USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	83	161
Zurückgenommen	-155	-219
Nettoabnahme	-72	-58
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	6	24
Zurückgenommen	-11	-30
Nettoabnahme	-5	-6
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	19	26
Zurückgenommen	-44	-29
Nettoabnahme	-25	-3
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	22	21
Zurückgenommen	-43	-26
Nettoabnahme	-21	-5
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	9	11
Zurückgenommen	-12	-17
Nettoabnahme	-3	-6
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-6	-4
Nettoabnahme	-5	-4
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	11	11
Zurückgenommen	-26	-13
Nettoabnahme	-15	-2
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	60	111
Zurückgenommen	-246	-123
Nettoabnahme	-186	-12
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	5	7
Zurückgenommen	-14	-13
Nettoabnahme	-9	-6

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	3	40
Zurückgenommen	-28	-98
Nettoabnahme	-25	-58
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	10	9
Zurückgenommen	-11	-35
Nettoabnahme	-1	-26
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	4	14
Zurückgenommen	-21	-9
Nettozunahme/-abnahme	-17	5
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	5	20
Zurückgenommen	-16	-31
Nettoabnahme	-11	-11
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	218	417
Zurückgenommen	-693	-657
Nettoabnahme	-475	-240
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	10	11
Zurückgenommen	-11	-11
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	67	341
Zurückgenommen	-142	-77
Nettozunahme/-abnahme	-75	264
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	73	101
Zurückgenommen	-320	-65
Nettozunahme/-abnahme	-247	36
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	40	113
Zurückgenommen	-145	-144
Nettoabnahme	-105	-31
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	5
Zurückgenommen	-7	-15
Nettoabnahme	-4	-10
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	39	40
Zurückgenommen	-52	-87
Nettoabnahme	-13	-47
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	330	276
Zurückgenommen	-249	-293
Nettozunahme/-abnahme	81	-17
Klasse S USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	35	145
Zurückgenommen	-58	-19
Nettozunahme/-abnahme	-23	126
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	45	371
Zurückgenommen	-554	-137
Nettozunahme/-abnahme	-509	234
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	49	161
Zurückgenommen	-85	-161
Nettoabnahme	-36	–
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	21
Zurückgenommen	-13	-1
Nettozunahme/-abnahme	-13	20
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-2

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse GA USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^{^*}		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	9	33
Zurückgenommen	-205	-75
Nettoabnahme	-196	-42
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	3
Zurückgenommen	-48	-24
Nettoabnahme	-47	-21
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5	22
Zurückgenommen	-32	-27
Nettoabnahme	-27	-5
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	12	17
Zurückgenommen	-36	-30
Nettoabnahme	-24	-13
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-3	-2
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	6
Zurückgenommen	-18	-9
Nettoabnahme	-17	-3
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	–	5
Zurückgenommen	-10	-4
Nettozunahme/-abnahme	-10	1
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-3	-1
Nettoabnahme	-2	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	24	361
Zurückgenommen	-805	-3.086
Nettoabnahme	-781	-2.725
Klasse B USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-23	-5
Nettoabnahme	-23	-4
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	1
Zurückgenommen	-36	-5
Nettoabnahme	-35	-4
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	3
Zurückgenommen	-17	-7
Nettoabnahme	-17	-4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund** – (Fortsetzung)		
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	-3	–
Nettoabnahme	-3	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-26	-7
Nettoabnahme	-25	-5
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-3	-1
Nettozunahme/-abnahme	-3	1
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	-15	-4
Nettoabnahme	-15	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-4	–
Nettoabnahme	-3	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	6	5
Zurückgenommen	-34	-11
Nettoabnahme	-28	-6
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-13	-2
Nettoabnahme	-12	-2
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-6	-1
Nettoabnahme	-6	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	26
Zurückgenommen	-60	-55
Nettoabnahme	-59	-29
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	-56	-9
Nettoabnahme	-54	-8
Klasse B (G) USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-21	-8
Nettoabnahme	-21	-8

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GE USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse GE EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund*		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	7	18
Zurückgenommen	-11	-15
Nettozunahme/-abnahme	-4	3
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	5	11
Zurückgenommen	-9	-8
Nettozunahme/-abnahme	-4	3
Klasse A USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	–	10
Zurückgenommen	-5	-10
Nettoabnahme	-5	–
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	–	6
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-1
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	9
Zurückgenommen	-6	-2
Nettozunahme/-abnahme	-6	7
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	330	232
Zurückgenommen	-196	-111
Nettozunahme	134	121
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2	9
Zurückgenommen	-20	-19
Nettoabnahme	-18	-10
Klasse F EUR Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	4	271
Zurückgenommen	-90	-392
Nettoabnahme	-86	-121
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	33
Zurückgenommen	-11	-53
Nettoabnahme	-10	-20
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	40	24
Zurückgenommen	-56	-56
Nettoabnahme	-16	-32
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	7
Zurückgenommen	-3	-51
Nettoabnahme	-3	-44
Klasse A SEK Thesaurierend		
Verkauft	47	40
Zurückgenommen	-446	-420
Nettoabnahme	-399	-380
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2	2
Zurückgenommen	-4	-16
Nettoabnahme	-2	-14
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	9	3
Zurückgenommen	-13	-29
Nettoabnahme	-4	-26
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	2	8
Zurückgenommen	-3	-17
Nettoabnahme	-1	-9
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-7	-46
Nettoabnahme	-7	-44
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-5	-4
Nettoabnahme	-4	–
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	29	159
Zurückgenommen	-192	-609
Nettoabnahme	-163	-450
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	32	101
Zurückgenommen	-57	-602
Nettoabnahme	-25	-501
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-8	-4
Nettoabnahme	-8	-3
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	39	104
Zurückgenommen	-93	-77
Nettozunahme/-abnahme	-54	27

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	90	964
Zurückgenommen	-1.371	-2.077
Nettoabnahme	-1.281	-1.113
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1.622	386
Zurückgenommen	-693	-369
Nettozunahme	929	17
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	38	422
Zurückgenommen	-294	-380
Nettozunahme/-abnahme	-256	42
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	8	246
Zurückgenommen	-40	-326
Nettoabnahme	-32	-80
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	110	224
Zurückgenommen	-315	-212
Nettozunahme/-abnahme	-205	12
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	20	76
Zurückgenommen	-68	-32
Nettozunahme/-abnahme	-48	44
Klasse LM EUR Thesaurierend		
Verkauft	44	134
Zurückgenommen	-59	-41
Nettozunahme/-abnahme	-15	93
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	220	–
Zurückgenommen	-32	–
Nettozunahme	188	–
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	134	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	129	–
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	43	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	38	–
Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	10	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	5	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	6	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	5	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	51	–
Zurückgenommen	-4	–
Nettozunahme	47	–
Klasse A GBP Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	1	–
Klasse A HKD Thesaurierend		
Verkauft	9	–
Nettozunahme	9	–
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	3	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1.859	–
Zurückgenommen	-69	–
Nettozunahme	1.790	–
Klasse B USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund – (Fortsetzung)		
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	54	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	53	–
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	97	–
Zurückgenommen	-15	–
Nettozunahme	82	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	36	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	34	–
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	8	–
Nettozunahme	8	–
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	75	–
Zurückgenommen	-8	–
Nettozunahme	67	–
Klasse F USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	37	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	35	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	7	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	7	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	74	–
Zurückgenommen	-6	–
Nettozunahme	68	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	91	63
Zurückgenommen	-113	-25
Nettozunahme/-abnahme	-22	38
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	30	–
Zurückgenommen	-12	–
Nettozunahme	18	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	1	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	205	–
Zurückgenommen	-10	–
Nettozunahme	195	–
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	89	–
Nettozunahme	89	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	35	–
Nettozunahme	35	–
Klasse A (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	167	–
Zurückgenommen	-7	–
Nettozunahme	160	–
Klasse B (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse L (G) USD Thesaurierend		
Verkauft	60	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	58	–
Klasse GA EUR Thesaurierend		
Verkauft	2	–
Nettozunahme	2	–
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse GE USD Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Nettozunahme	1	–
Klasse GE EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^		
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	1.021	1.987
Zurückgenommen	-1.531	-1.717
Nettozunahme/-abnahme	-510	270
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	1.357	646
Zurückgenommen	-474	-638
Nettozunahme	883	8
Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	1.562	1.942
Zurückgenommen	-1.304	-2.128
Nettozunahme/-abnahme	258	-186
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	17	1
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	15	1
Klasse A USD Ausschüttend (Q)		
Verkauft	110	21
Zurückgenommen	-120	-66
Nettoabnahme	-10	-45
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	175	86
Zurückgenommen	-235	-189
Nettoabnahme	-60	-103
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	3.359	1.327
Zurückgenommen	-3.574	-13.588
Nettoabnahme	-215	-12.261
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	548	122
Zurückgenommen	-95	-113
Nettozunahme	453	9
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	10.653	3.448
Zurückgenommen	-2.297	-3.323
Nettozunahme	8.356	125
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	160	76
Zurückgenommen	-7	-13
Nettozunahme	153	63
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	223	73
Zurückgenommen	-124	-154
Nettozunahme/-abnahme	99	-81

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^ – (Fortsetzung)		
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	3.521	2.831
Zurückgenommen	-2.301	-3.677
Nettozunahme/-abnahme	1.220	-846
Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	24
Zurückgenommen	-21	-25
Nettoabnahme	-21	-1
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	51	12
Zurückgenommen	-19	-68
Nettozunahme/-abnahme	32	-56
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	48
Zurückgenommen	-50	-57
Nettoabnahme	-46	-9
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	81	14
Zurückgenommen	-59	-83
Nettozunahme/-abnahme	22	-69
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	325	79
Zurückgenommen	-25	-3
Nettozunahme	300	76
Klasse E EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	6	22
Zurückgenommen	–	-7
Nettozunahme	6	15
Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	23	198
Zurückgenommen	-240	-58
Nettozunahme/-abnahme	-217	140
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	93	26
Zurückgenommen	-13	-147
Nettozunahme/-abnahme	80	-121
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	28	23
Zurückgenommen	–	-10
Nettozunahme	28	13
Klasse X USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	33	–
Zurückgenommen	-8	-18
Nettozunahme/-abnahme	25	-18
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	1.262	61
Zurückgenommen	-40	-96
Nettozunahme/-abnahme	1.222	-35
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	2.027	725
Zurückgenommen	-892	-738
Nettozunahme/-abnahme	1.135	-13
Klasse X GBP ausschüttend (Q) (Abgesichert)		
Verkauft	13	7
Zurückgenommen	-20	–
Nettozunahme/-abnahme	-7	7
Klasse X GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	16	125
Zurückgenommen	-93	-83
Nettozunahme/-abnahme	-77	42
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	6.470	1.121
Zurückgenommen	-2.146	-748
Nettozunahme	4.324	373
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	14	3
Zurückgenommen	-26	-81
Nettoabnahme	-12	-78
Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	173	156
Nettozunahme	173	156
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)		
Verkauft	1.192	674
Zurückgenommen	-22	-752
Nettozunahme/-abnahme	1.170	-78

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	2.593	1.566
Zurückgenommen	-1.916	-8.471
Nettozunahme/-abnahme	677	-6.905
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-4	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)		
Verkauft	1	15
Zurückgenommen	-17	-81
Nettoabnahme	-16	-66
Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)		
Verkauft	222	515
Zurückgenommen	-392	-3.390
Nettoabnahme	-170	-2.875
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	3.425	7.176
Zurückgenommen	-996	-2.810
Nettozunahme	2.429	4.366
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	32	8
Zurückgenommen	-50	-84
Nettoabnahme	-18	-76
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	15	41
Zurückgenommen	-141	-215
Nettoabnahme	-126	-174
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	118	43
Zurückgenommen	-157	-217
Nettoabnahme	-39	-174
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	16	5
Zurückgenommen	-28	-11
Nettoabnahme	-12	-6
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus		
Verkauft	488	30
Zurückgenommen	-121	-56
Nettozunahme/-abnahme	367	-26
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)		
Verkauft	2	1
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	2	1
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	56	26
Zurückgenommen	-13	-41
Nettozunahme/-abnahme	43	-15
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	6	1
Zurückgenommen	-23	-5
Nettoabnahme	-17	-4
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	-29	-17
Nettoabnahme	-29	-17
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Verkauft	26.268	16.541
Zurückgenommen	-26.085	-31.355
Nettozunahme/-abnahme	183	-14.814
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Verkauft	17	11
Zurückgenommen	-9	-12
Nettozunahme/-abnahme	8	-1
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	33	3
Zurückgenommen	-11	-5
Nettozunahme/-abnahme	22	-2

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)		
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	4	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	4	–
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	281	94
Zurückgenommen	-161	-3
Nettozunahme	120	91
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	121	603
Zurückgenommen	-543	-363
Nettozunahme/-abnahme	-422	240
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	77	2
Zurückgenommen	-43	-294
Nettozunahme/-abnahme	34	-292
Klasse Premier GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	3	7
Zurückgenommen	-11	-98
Nettoabnahme	-8	-91
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	141	8
Zurückgenommen	-19	-16
Nettozunahme/-abnahme	122	-8
Klasse S EUR Thesaurierend		
Verkauft	58	51
Zurückgenommen	-43	-24
Nettozunahme	15	27
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	4
Zurückgenommen	–	-2
Nettozunahme	–	2
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	35	2
Zurückgenommen	-2	-1
Nettozunahme	33	1
Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	3	7
Zurückgenommen	-4	-5
Nettozunahme/-abnahme	-1	2
Klasse S GBP Thesaurierend		
Verkauft	21	25
Zurückgenommen	-24	-29
Nettoabnahme	-3	-4
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	17	8
Zurückgenommen	-4	-2
Nettozunahme	13	6
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)		
Verkauft	352	30
Zurückgenommen	-18	-10
Nettozunahme	334	20
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Verkauft	73	52
Zurückgenommen	-62	-114
Nettozunahme/-abnahme	11	-62
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	11	3
Zurückgenommen	-39	-18
Nettoabnahme	-28	-15
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund**		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	167	397
Zurückgenommen	-305	-349
Nettozunahme/-abnahme	-138	48

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	25
Zurückgenommen	-10	-19
Nettozunahme/-abnahme	-7	6
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	51	58
Zurückgenommen	-56	-61
Nettoabnahme	-5	-3
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	47	137
Zurückgenommen	-98	-187
Nettoabnahme	-51	-50
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	169	89
Zurückgenommen	-52	-46
Nettozunahme	117	43
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	90	188
Zurückgenommen	-121	-56
Nettozunahme/-abnahme	-31	132
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)		
Verkauft	3	3
Zurückgenommen	-4	-3
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	–
Klasse A GBP Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	20	3
Zurückgenommen	-8	-1
Nettozunahme	12	2
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	5.491	7.743
Zurückgenommen	-7.828	-15.088
Nettoabnahme	-2.337	-7.345
Klasse A SGD Thesaurierend		
Verkauft	1.746	1.358
Zurückgenommen	-2.280	-1.896
Nettoabnahme	-534	-538
Klasse B USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse B USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	6	22
Zurückgenommen	-24	-10
Nettozunahme/-abnahme	-18	12
Klasse C USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-2
Nettoabnahme	-1	-2
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	11	59
Zurückgenommen	-47	-21
Nettozunahme/-abnahme	-36	38
Klasse E USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	1
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	4	5
Zurückgenommen	-13	-4
Nettozunahme/-abnahme	-9	1
Klasse E EUR Thesaurierend		
Verkauft	5	15
Zurückgenommen	-6	-4
Nettozunahme/-abnahme	-1	11

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)					
Klasse F USD Thesaurierend					
Verkauft	5	16		9	13
Zurückgenommen	-16	-12		-5	-3
Nettozunahme/-abnahme	-11	4		4	10
Klasse F USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	2	1		–	–
Zurückgenommen	-1	–		–	–
Nettozunahme	1	1		–	–
Klasse R EUR Thesaurierend					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse X USD Thesaurierend					
Verkauft	153	62		–	–
Zurückgenommen	-179	-125		–	–
Nettoabnahme	-26	-63		–	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	2	14		–	–
Zurückgenommen	-4	-3		–	–
Nettozunahme/-abnahme	-2	11		–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	157	113		–	–
Zurückgenommen	-131	-40		–	–
Nettozunahme	26	73		–	–
Klasse X EUR Thesaurierend					
Verkauft	40	204		–	–
Zurückgenommen	-175	-47		–	–
Nettozunahme/-abnahme	-135	157		–	–
Klasse X GBP Thesaurierend					
Verkauft	18	41		–	–
Zurückgenommen	-60	-31		–	–
Nettozunahme/-abnahme	-42	10		–	–
Klasse X GBP Ausschüttend (A)					
Verkauft	3	1		–	–
Zurückgenommen	-2	-2		–	–
Nettozunahme/-abnahme	1	-1		–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend					
Verkauft	289	833		–	–
Zurückgenommen	-382	-508		-1	–
Nettozunahme/-abnahme	-93	325		-1	–
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	3	2		–	–
Zurückgenommen	-14	-109		-1	–
Nettoabnahme	-11	-107		-1	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	40	142		–	–
Zurückgenommen	-51	-133		–	–
Nettozunahme/-abnahme	-11	9		–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend					
Verkauft	114	79		–	–
Zurückgenommen	-126	-41		–	–
Nettozunahme/-abnahme	-12	38		–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend					
Verkauft	23	15		–	–
Zurückgenommen	-20	-29		–	–
Nettozunahme/-abnahme	3	-14		–	–
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	34	372		–	–
Zurückgenommen	-84	-433		-1	-1
Nettoabnahme	-50	-61		-1	–
FTGF Royce US Smaller Companies Fund					
Klasse A USD Thesaurierend					
Verkauft	13	20		–	–
Zurückgenommen	-31	-33		–	-1
Nettoabnahme	-18	-13		–	-1
Klasse A USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	4	4		-1	–
Zurückgenommen	-5	-6		-1	–
Nettoabnahme	-1	-2		–	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	7	2		–	-1
Zurückgenommen	-2	-1		–	-1
Nettozunahme	5	1		–	–
Klasse A EUR Thesaurierend					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse A GBP Ausschüttend (A)					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse C USD Thesaurierend					
Verkauft	–	2		–	2
Zurückgenommen	-2	-2		-2	-2
Nettoabnahme	-2	–		-2	–
Klasse C USD Ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	-1	-2		-1	-2
Nettoabnahme	-1	-2		-1	-2
Klasse E USD Thesaurierend					
Verkauft	–	2		–	2
Zurückgenommen	–	-1		–	-1
Nettozunahme	–	1		–	1
Klasse E USD Ausschüttend (A)					
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse E EUR Thesaurierend					
Verkauft	–	1		–	1
Zurückgenommen	-1	–		-1	–
Nettozunahme/-abnahme	-1	1		-1	1
Klasse F USD Thesaurierend					
Verkauft	3	5		3	5
Zurückgenommen	-20	-6		-20	-6
Nettoabnahme	-17	-1		-17	-1
Klasse F USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	-1	–		-1	–
Nettoabnahme	-1	–		-1	–
Klasse X USD Thesaurierend					
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse X USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	–	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse Premier USD Thesaurierend					
Verkauft	1	1		1	1
Zurückgenommen	-1	-31		-1	-31
Nettoabnahme	–	-30		–	-30
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)					
Verkauft	13	62		13	62
Zurückgenommen	-19	-58		-19	-58
Nettozunahme/-abnahme	-6	4		-6	4
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)					
Verkauft	–	1		–	1
Zurückgenommen	-1	-1		-1	-1
Nettoabnahme	-1	–		-1	–
Klasse P2 USD Thesaurierend					
Verkauft	–	–		–	–
Nettozunahme	–	–		–	–
Klasse LM EUR Thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-1		–	-1
Nettoabnahme	–	-1		–	-1
Klasse A (G) USD Thesaurierend					
Zurückgenommen	-1	–		-1	–
Nettoabnahme	-1	–		-1	–
Klasse L (G) USD Thesaurierend					
Zurückgenommen	–	-1		–	-1
Nettoabnahme	–	-1		–	-1

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^{^*}µ		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-6	-18
Nettoabnahme	-6	-18
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-76	-89
Nettoabnahme	-76	-89
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-12	-12
Nettoabnahme	-12	-12
Klasse C USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	3	–
Zurückgenommen	-10	-9
Nettoabnahme	-7	-9
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse X USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-7	-6
Nettoabnahme	-7	-6
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	-3	-3
Nettoabnahme	-3	-3
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	-7	-65
Nettoabnahme	-7	-57
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	64
Zurückgenommen	–	-617
Nettoabnahme	–	-553
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	8
Zurückgenommen	-21	-41
Nettoabnahme	-21	-33
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund[^]		
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-54
Nettoabnahme	–	-54
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	-7
Nettoabnahme	–	-7
Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-5
Nettoabnahme	–	-5

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus		
Verkauft	–	26
Zurückgenommen	–	-97
Nettoabnahme	–	-71
Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-36
Nettoabnahme	–	-36
Klasse D AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D HKD Ausschüttend (M) Plus		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus		
Zurückgenommen	–	-325
Nettoabnahme	–	-325
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	-45
Nettoabnahme	–	-45
Klasse X AUD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-2
Nettoabnahme	–	-2
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-3
Nettoabnahme	–	-3
Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)		
Zurückgenommen	–	-4
Nettoabnahme	–	-4
Klasse LM AUD Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-47
Nettoabnahme	–	-47
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund^{^*}		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-18	-23
Nettoabnahme	-18	-22
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	8	3
Zurückgenommen	-67	-29
Nettoabnahme	-59	-26
Klasse Premier USD Thesaurierend		
Verkauft	16	45
Zurückgenommen	-19	-7
Nettozunahme/-abnahme	-3	38
Klasse S GBP Thesaurierend		
Verkauft	15	–
Nettozunahme	15	–
Klasse P2 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	-1
Nettoabnahme	-1	-1
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-87	-5
Nettoabnahme	-87	-5
FTGF Franklin European Unconstrained Fund^{^*}φ*		
Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	4
Zurückgenommen	-9	-8
Nettoabnahme	-8	-4

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^]* – (Fortsetzung)		
Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-4	–
Nettoabnahme	-4	–
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	–	-35
Nettoabnahme	–	-33
Klasse Premier EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	24
Zurückgenommen	–	-30
Nettoabnahme	–	-6
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Verkauft	–	2
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme/-abnahme	-2	2
Klasse P1 EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	81
Zurückgenommen	-69	-576
Nettoabnahme	-69	-495
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	65
Zurückgenommen	-733	-314
Nettoabnahme	-733	-249
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]Ω		
Klasse A USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	1
Zurückgenommen	-8	–
Nettozunahme/-abnahme	-8	1
Klasse X GBP Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P1 USD Thesaurierend		
Zurückgenommen	-47	–
Nettoabnahme	-47	–
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Zurückgenommen	-1	–
Nettoabnahme	-1	–
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	30
Zurückgenommen	-3	-31
Nettoabnahme	-3	-1
Klasse P1 GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	21
Zurückgenommen	-7	-14
Nettozunahme/-abnahme	-7	7
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	2	70
Zurückgenommen	-61	-11
Nettozunahme/-abnahme	-59	59
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	1	–
Zurückgenommen	-15	-20
Nettoabnahme	-14	-20
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	1	2
Zurückgenommen	-46	-25
Nettoabnahme	-45	-23
Klasse D EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	-1	-4
Nettoabnahme	-1	-4

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse X EUR Thesaurierend		
Zurückgenommen	–	-1
Nettoabnahme	–	-1
Klasse X EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	3	1
Zurückgenommen	-52	-17
Nettoabnahme	-49	-16
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	98
Zurückgenommen	-5	-26
Nettozunahme/-abnahme	-5	72
Klasse A EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	286
Zurückgenommen	-10	-36
Nettozunahme/-abnahme	-10	250
Klasse D EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	25
Zurückgenommen	–	-25
Nettozunahme	–	–
Klasse D EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	25
Zurückgenommen	–	-25
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	25
Zurückgenommen	–	-25
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	25
Zurückgenommen	–	-25
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	25
Zurückgenommen	–	-25
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	224
Zurückgenommen	-6	-175
Nettozunahme/-abnahme	-6	49
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]Ψ		
Klasse A EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A EUR Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A1 EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A1 EUR Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse K EUR Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend		
Verkauft	50	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	50	–
Klasse X EUR Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^{^γ}		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	14.495	–
Zurückgenommen	-6.872	–
Nettozunahme	7.623	–
Klasse A USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1.903	–
Zurückgenommen	-812	–
Nettozunahme	1.091	–
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	101	–
Nettozunahme	101	–
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	17	–
Zurückgenommen	-1	–
Nettozunahme	16	–
Klasse AX USD Thesaurierend		
Verkauft	3.933	–
Zurückgenommen	-1.409	–
Nettozunahme	2.524	–
Klasse AX USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	210	–
Zurückgenommen	-66	–
Nettozunahme	144	–
Klasse E USD Thesaurierend		
Verkauft	211	–
Zurückgenommen	-122	–
Nettozunahme	89	–
Klasse E USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	69	–
Zurückgenommen	-4	–
Nettozunahme	65	–
Klasse F USD Thesaurierend		
Verkauft	2.719	–
Zurückgenommen	-1.497	–
Nettozunahme	1.222	–
Klasse F USD Ausschüttend (D)		
Verkauft	1.022	–
Zurückgenommen	-453	–
Nettozunahme	569	–
Klasse X USD Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	1.663	–
Zurückgenommen	-704	–
Nettozunahme	959	–

	Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse LM USD Thesaurierend		
Verkauft	500	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	500	–
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^{^δ}		
Klasse A USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	33	–
Zurückgenommen	-9	–
Nettozunahme	24	–
Klasse B USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	8	–
Zurückgenommen	-2	–
Nettozunahme	6	–
Klasse C USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	22	–
Zurückgenommen	-8	–
Nettozunahme	14	–
Klasse F USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)		
Verkauft	33	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	33	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	99	–
Zurückgenommen	-99	–
Nettozunahme	–	–
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	141	–
Zurückgenommen	-22	–
Nettozunahme	119	–
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)		
Verkauft	4	–
Zurückgenommen	-4	–
Nettozunahme	–	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	54	–
Zurückgenommen	-7	–
Nettozunahme	47	–
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^{^λ}		
Klasse A USD Thesaurierend		
Verkauft	329	–
Zurückgenommen	-168	–
Nettozunahme	161	–
Klasse X GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–
Klasse S USD Thesaurierend		
Verkauft	95	–
Zurückgenommen	-5	–
Nettozunahme	90	–
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)		
Verkauft	415	–
Zurückgenommen	-163	–
Nettozunahme	252	–
Klasse P2 EUR Thesaurierend		
Verkauft	27	–
Zurückgenommen	-12	–
Nettozunahme	15	–
Klasse P2 GBP Thesaurierend		
Verkauft	–	–
Zurückgenommen	–	–
Nettozunahme	–	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

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

	Für das Geschäftsjahr zum			Für das Geschäftsjahr zum	
	28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)		28. Februar 2026 Anteile (in Tsd.)	28. Februar 2025 Anteile (in Tsd.)
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund ^α					
Klasse A USD Thesaurierend					
Verkauft	385	–		4	–
Zurückgenommen	-15	–		–	–
Nettozunahme	370	–		4	–
Klasse A EUR Thesaurierend					
Verkauft	120	–		3	–
Zurückgenommen	-98	–		–	–
Nettozunahme	22	–		3	–
Klasse A EUR Ausschüttend (A)					
Verkauft	6	–		–	–
Zurückgenommen	–	–		–	–
Nettozunahme	6	–		–	–
Klasse C USD Thesaurierend					
Verkauft	2	–		694	–
Zurückgenommen	–	–		-62	–
Nettozunahme	2	–		632	–
Klasse E USD Thesaurierend					
Verkauft	106	–			
Zurückgenommen	-11	–			
Nettozunahme	95	–			
Klasse F USD Thesaurierend					
Verkauft	141	–			
Zurückgenommen	-6	–			
Nettozunahme	135	–			
Klasse X USD Thesaurierend					
Verkauft	7	–			
Zurückgenommen	-1	–			
Nettozunahme	6	–			
Klasse X EUR Thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse X GBP Thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse Premier USD Thesaurierend					
Verkauft	195	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	195	–			
Klasse Premier GBP Thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse S USD Thesaurierend					
Verkauft	760	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	760	–			
Klasse S GBP Thesaurierend					
Verkauft	–	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse P1 USD Thesaurierend					
Verkauft	2.680	–			
Zurückgenommen	-2.680	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse P2 USD Thesaurierend					
Verkauft	1.695	–			
Zurückgenommen	-707	–			
Nettozunahme	988	–			
Klasse P2 USD Ausschüttend (M)					
Verkauft	–	–			
Nettozunahme	–	–			
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft	4	–			
Zurückgenommen	–	–			
Nettozunahme	4	–			
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft					
Zurückgenommen					
Nettozunahme					
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft					
Zurückgenommen					
Nettozunahme					
Klasse P2 USD Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft					
Zurückgenommen					
Nettozunahme					
FTGF Putnam Balanced Fund ^{αβ}					
Klasse A USD Thesaurierend					
Verkauft				35	–
Zurückgenommen				-11	–
Nettozunahme				24	–
Klasse C USD Thesaurierend					
Verkauft				37	–
Zurückgenommen				-22	–
Nettozunahme				15	–
Klasse D USD Thesaurierend					
Verkauft				2.372	–
Zurückgenommen				-938	–
Nettozunahme				1.434	–
Klasse E USD Thesaurierend					
Verkauft				674	–
Zurückgenommen				-249	–
Nettozunahme				425	–
Klasse F USD Thesaurierend					
Verkauft				81	–
Zurückgenommen				-29	–
Nettozunahme				52	–
Klasse Premier USD Thesaurierend					
Verkauft				1	–
Nettozunahme				1	–
Klasse P2 USD Thesaurierend					
Verkauft				50	–
Zurückgenommen				-50	–
Nettozunahme				–	–
FTGF Putnam Global Healthcare Fund ^①					
Klasse A USD Thesaurierend					
Verkauft				2	–
Nettozunahme				2	–
Klasse A HKD Thesaurierend					
Verkauft				–	–
Nettozunahme				–	–
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft				1	–
Nettozunahme				1	–
Klasse Premier USD Thesaurierend					
Verkauft				30	–
Nettozunahme				30	–
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)					
Verkauft				–	–
Nettozunahme				–	–
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)					
Verkauft				1	–
Nettozunahme				1	–

Die begleitenden Erläuterungen sind ein integraler Bestandteil des Abschlusses.

– Mit „–“ angegebene Beträge belaufen sich auf 0 oder auf weniger als 1.000. Es sind nur Klassen angegeben, bei denen im Geschäftsjahr Transaktionen erfolgt sind.

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

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

γ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^] den Handel auf.

δ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^] den Handel auf.

λ Mit Wirkung vom 4. April 2025 nahm der FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^] den Handel auf.

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

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

Ω Mit Wirkung vom 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel ein.

η Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] den Handel ein.

φ Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

μ Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 hat der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^] den Handel eingestellt.

Ψ Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] den Handel auf.

* Nähere Angaben zu Änderungen von Fondsnamen und Verschmelzungen sind der Erläuterung 14 zu entnehmen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss

1. Allgemeines

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

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

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze

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

Übereinstimmungserklärung

Der Jahresabschluss für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 wurde im Einklang mit den in Irland allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen einschließlich des Financial Reporting Standard („FRS“) 102: „The Financial Reporting Standard applicable in the United Kingdom and the Republic of Ireland“ („FRS 102“) und irischem Recht einschließlich des Companies Act 2014, der OGAW-Vorschriften und der OGAW-Bestimmungen der Zentralbank erstellt. Diese Regelungen entsprechen denjenigen, die bei der Erstellung des Jahresabschlusses für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 angewendet wurden.

Grundlage der Aufstellung

Der Abschluss wurde auf der Grundlage der Fortführung der Geschäftstätigkeit der Gesellschaft nach dem Prinzip der historischen Kosten erstellt, das durch die Neubewertung von finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert gehalten werden, modifiziert wurde. Die Jahresabschlüsse der folgenden Fonds wurden auf einer anderen Grundlage als dem Fortführungsprinzip erstellt, da diese Fonds im laufenden Geschäftsjahr und in Vorjahren oder nach dem Abschlussstichtag geschlossen wurden:

Fonds	Datum der Schließung
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	29. Juli 2024
Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]	16. Februar 2023
Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]	10. Oktober 2022
Legg Mason Western Asset US Short-Term Government Fund [^]	8. November 2019
Legg Mason Western Asset US Adjustable Rate Fund [^]	2. August 2019
Legg Mason Western Asset Global Inflation Management Fund [^]	5. Dezember 2022
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	29. Oktober 2024
FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund [^]	23. Oktober 2023
FTGF Western Asset US Corporate Bond Fund [^]	10. November 2023
FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund [^] ^π	5. Dezember 2023
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	4. August 2025
FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund [^] ^π	24. März 2023
FTGF Brandywine Global – US High Yield Fund [^]	29. Januar 2020
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	17. Juli 2024
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	19. Dezember 2024
FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund [^] ^π	24. März 2023
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	15. Juni 2026
Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]	15. Februar 2019
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund [^] *	31. Oktober 2025
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund ^{**}	8. Mai 2026
Legg Mason US Equity Fund [^]	30. August 2013
Franklin MV European Equity Growth and Income Fund [^]	11. Juli 2022
FTGF Franklin MV Asia Pacific Ex Japan Equity Growth and Income Fund [^]	17. Juli 2023
Legg Mason BatteryMarch International Large Cap Fund [^]	25. Februar 2015
Legg Mason QS Emerging Markets Equity Fund [^]	14. April 2021
Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund [^]	27. April 2022
Legg Mason Japan Equity Fund [^]	30. November 2010
FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund [^]	20. April 2023
Legg Mason Martin Currie Asia Pacific Fund [^]	21. August 2019
Legg Mason Martin Currie Global Resources Fund [^]	31. Juli 2017
Legg Mason Martin Currie Greater China Fund [^]	15. November 2019
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	12. Januar 2026
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	26. Juli 2024
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	18. August 2025
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	7. Juli 2025

* Mit Wirkung vom 31. Oktober 2025 verschmolzen mit dem FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund.

^π Die Genehmigung wurde auf Antrag der Gesellschaft am 7. Mai 2026 von der Zentralbank widerrufen.

** Mit Wirkung vom 8. Mai 2026 verschmolzen mit dem FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund.

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

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

(a) Wertpapiere des Anlagevermögens zum beizulegenden Zeitwert

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

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

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

Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in Finanzinstrumente investieren, die nicht an einem aktiven Markt gehandelt werden (z. B. in außerbörsliche Derivate). Der beizulegende Zeitwert wird mithilfe von Bewertungsmethoden ermittelt. Die Gesellschaft wendet eine Vielzahl von Methoden an und trifft Annahmen, die auf den zum Bilanzstichtag herrschenden Marktbedingungen basieren. Zu den angewendeten Bewertungsmethoden gehören der Rückgriff auf vergleichbare aktuelle Transaktionen zu marktüblichen Bedingungen, diskontierte Cashflow-Analysen und andere Bewertungsmethoden, die üblicherweise von Marktteilnehmern angewendet werden. Die diesen Instrumenten zugewiesenen Werte basieren auf den besten verfügbaren Informationen. Aufgrund der Unsicherheit der Bewertung

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – (Fortsetzung)

(a) Wertpapiere des Anlagevermögens zum beizulegenden Zeitwert – (Fortsetzung)

können diese Werte erheblich von den Werten abweichen, die erzielt worden wären, hätte es einen verfügbaren Markt für diese Instrumente gegeben. Diese Abweichungen können erheblich sein. Der Abschluss dieser Kontrakte beinhaltet in unterschiedlichem Maße Kredit-, Rechts-, Markt- und Dokumentationsrisiken, die über die in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Beträge hinausgehen. Solche Risiken beinhalten die Möglichkeit, dass es keinen liquiden Markt für diese Vereinbarungen geben wird, dass die Vertragspartner der Vereinbarungen ihren Verpflichtungen zur Erfüllung nicht nachkommen oder mit den vertraglichen Bedingungen in den Vereinbarungen nicht einverstanden sind oder dass es ungünstige Änderungen der Zinssätze oder des Preises des diesen Transaktionen zugrunde liegenden Index oder Wertpapiers geben kann. Die am Jahresende herangezogenen Preise, die von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden oder auf Bewertungsmethoden basieren, sind die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende. Es besteht jedoch ein gewisses Maß an Unsicherheit hinsichtlich dieser Preise. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Marktwert mit der betreffenden Gegenpartei zu schließen.

(b) Ansatz/Ausbuchung

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

(c) Preissetzung durch einzelnen Broker

Die am Jahresende herangezogenen Preise, die von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden, sind die beste Schätzung des beizulegenden Zeitwerts zum Jahresende. Es besteht jedoch ein gewisses Maß an Unsicherheit hinsichtlich dieser Preise. Es ist möglicherweise nicht immer möglich, die Positionen zum angegebenen Marktwert mit der betreffenden Gegenpartei zu schließen. Die Werte der Wertpapieren der einzelnen Fonds, deren Preise zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden, sind in Erläuterung 12.1 (d) angegeben.

(d) Bilanzierung von Finanzanlagen

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

(e) Erträge aus Anlagen

In der Gesamtergebnisrechnung werden Zinserträge und -aufwendungen für alle Schuldtitel nach der Effektivzinismethode ausgewiesen. Die Anlageverwalter überwachen ausstehende Zinserträge für sämtliche rückständigen Zinsforderungen. Die Konten wurden auf rückständige Zinsforderungen geprüft. Zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 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 rückstattungsfähiger Quellensteuern, die getrennt in der Gesamtergebnisrechnung erscheinen, ausgewiesen.

(f) Aufrechnung von Finanzinstrumenten

Finanzielle Vermögenswerte und finanzielle Verbindlichkeiten werden miteinander saldiert und der Nettobetrag in der Bilanz ausgewiesen, falls es ein einklagbares Recht gibt, die anerkannten Beträge miteinander zu saldieren, und falls die Absicht besteht, auf Nettobasis abzuschließen, oder die Aktiva zu realisieren (verkaufen) und gleichzeitig einen Ausgleich für die Verbindlichkeiten zu finden. Zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 lag keine Saldierung von Finanzinstrumenten vor.

(g) Wichtige rechnungslegungsbezogene Schätzungen und Annahmen

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

Beizulegender Zeitwert von Finanzderivaten

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

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

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

(h) Wertpapierleihe

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

Zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 waren keine Fonds an Wertpapierleihgeschäften beteiligt.

(i) Ausgleich

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

Ertragsausgleich

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

Aufwandsausgleich

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

(j) Aufwendungen

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

(k) Transaktionskosten

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

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

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

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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – (Fortsetzung)

(l) Währungsumrechnung

- (a) Leit- und Darstellungswährung: Alle Posten, die im Abschluss der Gesellschaft ausgewiesen sind, werden in der Währung ihres primären wirtschaftlichen Umfelds (die „Leitwährung“) bewertet. Bei allen Fonds ist dies der US-Dollar, außer beim FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], Franklin MV European Equity Growth and Income Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^] und FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^], deren funktionale Währung der Euro ist, beim FTGF Western Asset UK Investment Grade Credit Fund[^], dessen funktionale Währung das Pfund Sterling (Britisches Pfund) ist, und beim Legg Mason Japan Equity Fund[^], dessen funktionale Währung der japanische Yen ist. Die Gesellschaft hat die Leitwährung jedes Fonds als Darstellungswährung für diesen Abschluss übernommen. Der Abschluss der Gesellschaft wird in US-Dollar dargestellt.
- (b) Käufe und Verkäufe von Wertpapieren sowie Erträge und Aufwendungen werden zu dem Wechselkurs umgerechnet, der am Buchungsdatum der betreffenden Transaktion gilt. Aktiva und Passiva werden zu dem am Ende des Geschäftsjahres geltenden Wechselkurs umgerechnet. Differenzen zwischen ausgewiesenen und eingenommenen oder gezahlten Ertrags- und Aufwandsbeträgen werden in der Gesamtergebnisrechnung unter dem Nettogewinn/-verlust aus erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten als Wechselkursgewinne/-verluste erfasst.

(m) Devisentermin- und Kassadevisengeschäfte

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

(n) Futures-Kontrakte

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

(o) Optionskontrakte

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

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

(p) Swap-Instrumente

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

Credit Default Swaps

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

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

Interest Rate Swaps

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

Aktien-Swaps

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

Total Return Swaps

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

Cross-Currency-Swaps

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

Inflationsswaps

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

Index-Swaps

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – (Fortsetzung)

(q) Differenzkontrakte

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

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

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

(s) Kurzfristige Anlagen

Termineinlagen werden zum Nennwert bewertet. Der beizulegende Zeitwert von Einlagenzertifikaten und Commercial Papers wird anhand der von einem unabhängigen Bewertungsdienst bereitgestellten „berechneten Mittelkurse“ geschätzt und entspricht in etwa dem beizulegenden Zeitwert zum Berichtsstichtag.

(t) Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte

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

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

(u) Börsengehandelte Fonds

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

(v) Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen

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

(w) Swaptions

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

(x) Treasury Inflation-Protected Securities (TIPS)

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

(y) Schulscheindarlehen und Darlehensbeteiligungen

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

(z) Master-Limited Partnership

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

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

(aa) Zinserträge und -aufwendungen

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

(ab) Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung

„Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ in der Bilanz umfassen Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Futures-Kontrakten.

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

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

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

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

(ad) Ausschüttungen an Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile

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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

2. Wesentliche Bilanzierungsgrundsätze – (Fortsetzung)

(ae) Leerverkaufte Wertpapiere

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

3. Effizientes Portfoliomanagement

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

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

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

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Ein Teil des Vermögens eines jeden Fonds kann in zusätzlichen liquiden Mitteln gehalten werden. Zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements kann jeder Fonds Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte abschließen. Einzelheiten zu allen umgekehrten Pensionsgeschäften am Ende des Geschäftsjahres werden im Anlagenportfolio offengelegt.

Die nachstehende Tabelle zeigt die Einnahmen aus umgekehrten Pensionsgeschäften in den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025:

Name des Fonds	28. Februar 2026 (in Tsd.)	28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	21.370 \$	19.764 \$

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

Wertpapierleihgeschäfte

Bestimmte Fonds können auch Wertpapierleihvereinbarungen zum Zwecke eines effizienten Portfoliomanagements, wie oben beschrieben, schließen. Bei solchen Transaktionen kann der Fonds seine Wertpapiere vorübergehend an einen Entleiher übertragen, wobei der Entleiher sich verpflichtet, dem Fonds zu einem vorher vereinbarten Zeitpunkt gleichwertige Wertpapiere zurückzugeben. Durch den Abschluss solcher Transaktionen versucht der Fonds, die Rendite seines Wertpapierportfolios zu erhöhen, indem er eine Gebühr für die Bereitstellung seiner Wertpapiere an den Entleiher erhält. In den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 wurden keine Wertpapierleihgeschäfte getätigt.

4. Betriebsaufwendungen und andere Transaktionen mit verbundenen Parteien

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

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

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	
Klasse A	0,800 %	Klasse A	1,100 %
Klasse B	1,050 %	Klasse B	1,350 %
Klasse C	1,300 %	Klasse C	1,600 %
Klasse E	1,400 %	Klasse E	1,700 %
Klasse X	0,600 %	Klasse F	0,650 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse R	0,700 %
Klasse LM	keine	Klasse T	1,100 %
Klasse A (G)	0,800 %	Klasse X	0,550 %
Klasse L(G)	0,800 %	Klasse Premier	0,400 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		Klasse S	0,400 %
Klasse A	0,800 %	Klasse P1	0,400 %
Klasse B	1,050 %	Klasse P2	0,300 %
Klasse C	1,300 %	Klasse LM	keine
Klasse E	1,400 %	FTGF Western Asset US High Yield Fund	
Klasse F	0,550 % ¹	Klasse A	0,950 %
Klasse R	0,400 %	Klasse B	1,200 %
Klasse T	0,800 %	Klasse C	1,450 %
Klasse X	0,300 %	Klasse E	1,550 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse F	0,700 %
Klasse S	0,300 %	Klasse R	0,550 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse T	0,950 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse X	0,450 %
Klasse LM	keine	Klasse Premier	0,450 %
Klasse GA	0,820 %	Klasse S	0,450 %
¹ Maximale Verwaltungsgebühr für Klasse F ausschüttend (D): 0,400 %.		Klasse P1	0,300 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		Klasse P2	0,450 %
Klasse A	1,000 %	Klasse LM	keine
Klasse B	1,250 %	Klasse A (G)	1,150 %
Klasse C	1,500 %	Klasse L(G)	1,650 %
Klasse E	1,600 %	Klasse GF	0,950 %
Klasse F	0,550 %		
Klasse R	0,600 %		
Klasse T	1,000 %		
Klasse S	0,270 %		
Klasse X	0,300 %		
Klasse Premier	0,300 %		
Klasse P1	0,300 %		
Klasse P2	0,300 %		
Klasse LM	keine		
Klasse A (G)	1,150 %		
Klasse B (G)	1,650 %		
Klasse L(G)	1,650 %		

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		FTGF Putnam US Research Fund	
Klasse A	1,100 %	Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,350 %	Klasse AX	0,720 %
Klasse C	1,600 %	Klasse B	1,750 %
Klasse E	1,700 %	Klasse C	1,750 %
Klasse F	0,800 %	Klasse D1	0,750 %
Klasse J	0,450 %	Klasse D2	1,000 %
Klasse R	0,700 %	Klasse E	2,000 %
Klasse T	1,100 %	Klasse F	1,000 %
Klasse X	0,450 %	Klasse R	0,750 %
Klasse Premier	0,450 %	Klasse T	1,250 %
Klasse S	0,450 %	Klasse X	0,400 %
Klasse P1	0,450 %	Klasse Premier	0,400 %
Klasse P2	0,350 %	Klasse S	0,300 %
Klasse LM	keine	Klasse P1	0,220 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		Klasse P2	0,250 %
Klasse A	1,650 %	Klasse LM	keine
Klasse B	1,900 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse C	2,150 %	Klasse B (G)	1,750 %
Klasse E	2,250 %	Klasse L(G)	1,750 %
Klasse F	1,300 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse J	0,750 %	Klasse GE	2,170 %
Klasse R	1,250 %	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	
Klasse T	1,650 %	Klasse A	1,250 %
Klasse X	1,150 %	Klasse B	1,750 %
Klasse Premier	1,150 %	Klasse C	1,750 %
Klasse S	1,150 %	Klasse E	2,000 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse F	1,000 %
Klasse P2	1,150 %	Klasse R	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse T	1,250 %
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		Klasse X	0,625 %
Klasse A	0,800 %	Klasse Premier	0,625 %
Klasse B	1,050 %	Klasse S	0,525 %
Klasse C	1,300 %	Klasse P1	0,625 %
Klasse E	1,400 %	Klasse P2	0,625 %
Klasse F	0,550 %	Klasse LM	keine
Klasse R	0,600 %	Klasse A (G)	1,250 %
Klasse T	0,800 %	Klasse L(G)	1,750 %
Klasse X	0,300 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse Premier	0,300 %	FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	
Klasse S	0,300 %	Klasse A	1,300 %
Klasse P1	0,200 %	Klasse B	1,800 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse C	1,800 %
Klasse LM	keine	Klasse E	2,050 %
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]		Klasse F	1,050 %
Klasse A	1,300 %	Klasse R	0,800 %
Klasse B	1,800 %	Klasse T	1,300 %
Klasse C	1,800 %	Klasse X	0,650 %
Klasse E	2,050 %	Klasse Premier	0,650 %
Klasse F	1,050 %	Klasse S	0,650 %
Klasse R	0,800 %	Klasse P1	0,650 %
Klasse T	1,300 %	Klasse P2	0,650 %
Klasse X	0,650 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,650 %	Klasse A (G)	1,300 %
Klasse S	0,500 %	Klasse B (G)	1,800 %
Klasse P1	0,150 %	Klasse L(G)	1,800 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse GA	1,420 %
Klasse LM	keine	Klasse GE	2,170 %
FTGF ClearBridge US Value Fund		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	
Klasse A	1,350 %	Klasse A	1,250 %
Klasse B	1,850 %	Klasse B	1,750 %
Klasse C	1,850 %	Klasse C	1,750 %
Klasse E	2,100 %	Klasse E	2,000 %
Klasse F	1,100 %	Klasse F	1,000 %
Klasse R	0,850 %	Klasse R	0,800 %
Klasse T	1,350 %	Klasse T	1,250 %
Klasse X	0,675 %	Klasse X	0,625 %
Klasse Premier	0,675 %	Klasse Premier	0,625 %
Klasse S	0,525 %	Klasse S	0,625 %
Klasse P1	0,675 %	Klasse P1	0,625 %
Klasse P2	0,675 %	Klasse P2	0,625 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^]	
		Klasse A	1,200 %
		Klasse B	1,700 %
		Klasse C	1,700 %
		Klasse E	1,950 %
		Klasse F	0,950 %
		Klasse R	0,700 %
		Klasse T	1,200 %
		Klasse X	0,600 %
		Klasse Premier	0,600 %
		Klasse S	0,500 %
		Klasse P1	0,500 %
		Klasse P2	0,400 %
		Klasse LM	keine

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^]		FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]	
Klasse A	1,300 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	1,800 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	1,800 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,050 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,050 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	0,800 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,300 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,650 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,650 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P1	0,650 %	Klasse P1	0,550 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse P2	0,550 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]		FTGF Franklin Global 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 R	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,750 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,600 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse P1	0,750 %
Klasse P2	0,750 %	Klasse P2	0,400 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %	Klasse J	0,650 %
Klasse T	1,500 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,750 %	Klasse T	1,500 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse X	0,750 %
Klasse S	0,600 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P2	0,400 %	Klasse P1	0,750 %
Klasse LM	keine	Klasse P2	0,550 %
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^]		Klasse LM	keine
Klasse A	1,300 %	FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^]	
Klasse B	1,800 %	Klasse A	1,500 %
Klasse C	1,800 %	Klasse B	2,000 %
Klasse E	2,050 %	Klasse C	2,000 %
Klasse F	1,050 %	Klasse E	2,250 %
Klasse R	0,800 %	Klasse F	1,250 %
Klasse T	1,300 %	Klasse R	1,000 %
Klasse X	0,650 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,650 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,650 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P1	0,150 %	Klasse P1	0,350 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse P2	0,350 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	1,500 %
Klasse B	2,000 %	Klasse B	2,000 %
Klasse C	2,000 %	Klasse C	2,000 %
Klasse E	2,250 %	Klasse E	2,250 %
Klasse F	1,250 %	Klasse F	1,250 %
Klasse R	1,000 %	Klasse R	1,000 %
Klasse T	1,500 %	Klasse T	1,500 %
Klasse X	0,750 %	Klasse X	0,750 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse Premier	0,750 %
Klasse S	0,600 %	Klasse S	0,750 %
Klasse P1	0,750 %	Klasse P1	0,350 %
Klasse P2	0,750 %	Klasse P2	0,400 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]	
Klasse A	1,500 %	Klasse A	0,60 %
Klasse B	2,000 %	Klasse D	1,15 %
Klasse C	2,000 %	Klasse K	0,60 %
Klasse E	2,250 %	Klasse X	0,20 %
Klasse F	1,250 %	Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]	
Klasse R	1,000 %	Klasse A	0,60 %
Klasse T	1,500 %	Klasse D	1,15 %
Klasse X	0,750 %	Klasse K	0,60 %
Klasse Premier	0,750 %	Klasse X	0,20 %
Klasse S	0,750 %		
Klasse P1	0,750 %		
Klasse P2	0,500 %		
Klasse LM	keine		
Klasse A (G)	1,250 %		
Klasse L(G)	1,750 %		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr	Fondsname	Max. Verwaltungs- gebühr
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]		FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^]	
Klasse A	0,600 %	Klasse A	1,350 %
Klasse A1	0,900 %	Klasse B	1,850 %
Klasse D	1,250 %	Klasse C	1,850 %
Klasse K	0,700 %	Klasse E	2,100 %
Klasse X	0,300 %	Klasse F	1,100 %
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]		Klasse R	0,850 %
Klasse A	0,550 %	Klasse T	1,350 %
Klasse AX	0,800 %	Klasse S	0,470 %
Klasse B	0,800 %	Klasse X	0,675 %
Klasse C	1,050 %	Klasse Premier	0,675 %
Klasse E	1,300 %	Klasse P1	0,300 %
Klasse F	0,300 %	Klasse P2	0,400 %
Klasse LM	keine	Klasse LM	keine
Klasse R	0,600 %	FTGF Putnam Balanced Fund[^]	
Klasse T	0,550 %	Klasse A	1,300 %
Klasse X	0,400 %	Klasse B	1,650 %
Klasse Premier	0,300 %	Klasse C	1,650 %
Klasse S	0,200 %	Klasse E	2,050 %
Klasse P1	0,300 %	Klasse D	1,250 %
Klasse P2	0,300 %	Klasse F	1,000 %
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]		Klasse R	0,900 %
Klasse A	1,100 %	Klasse T	1,300 %
Klasse B	1,350 %	Klasse S	0,500 %
Klasse C	1,600 %	Klasse X	0,650 %
Klasse E	1,700 %	Klasse Premier	0,650 %
Klasse F	0,800 %	Klasse P1	0,300 %
Klasse R	0,700 %	Klasse P2	0,300 %
Klasse T	1,100 %	Klasse LM	keine
Klasse X	0,500 %	FTGF Putnam Global Healthcare Fund[^]	
Klasse Premier	0,500 %	Klasse A	1,400 %
Klasse S	0,500 %	Klasse B	1,900 %
Klasse P1	0,500 %	Klasse C	1,900 %
Klasse P2	0,350 %	Klasse E	2,150 %
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^]		Klasse F	1,150 %
Klasse A	1,250 %	Klasse R	0,950 %
Klasse B	1,750 %	Klasse T	1,400 %
Klasse C	1,750 %	Klasse X	0,700 %
Klasse E	2,000 %	Klasse Premier	0,700 %
Klasse F	1,000 %	Klasse S	0,600 %
Klasse R	0,750 %	Klasse P1	0,300 %
Klasse T	1,250 %	Klasse P2	0,500 %
Klasse X	0,625 %	Klasse LM	keine
Klasse Premier	0,625 %		
Klasse S	0,400 %		
Klasse P1	0,250 %		
Klasse P2	0,250 %		

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

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

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

Für die am 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 endenden Geschäftsjahre wurden folgende Verwaltungsgebühren erlassen bzw. erstattet und sonstige Aufwendungen rückerlangt:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)		Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	
	Erlassene Verwaltungsgebühren	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige rückerlangte Aufwendungen	Erlassene Verwaltungsgebühren	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige rückerlangte Aufwendungen
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	82 \$	4 \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	– \$	12 \$	– \$	18 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	9 \$	– \$	5 \$	– \$
FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	– €	– €	1 €	15 €
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	27 \$	2 \$	13 \$	6 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	6 \$	2 \$	8 \$	8 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	11 \$	– \$	11 \$	– \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	28 \$	– \$	15 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	7 \$	– \$	3 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	1 \$	31 \$	– \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	– \$	– \$	26 \$	44 \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	– \$	78 \$	– \$	75 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	3 \$	1 \$	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	32 \$	– \$	44 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	2 \$	7 \$	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	19 \$	18 \$	68 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	– \$	– \$	– \$	10 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	– \$	– \$	44 \$	14 \$
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	20 \$	– \$	24 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	– \$	133 \$	– \$	– \$
FTGF Putnam US Research Fund	211 \$	– \$	– \$	– \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige rüberlangte Aufwendungen	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	Erstattete Verwaltungsgebühren und sonstige rüberlangte Aufwendungen
	Erlassene Verwaltungsgebühren		Erlassene Verwaltungsgebühren	
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	1 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	26 \$	– \$	31 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	19 \$	– \$	31 \$	– \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	1 €	– €	– €	– €
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	22 \$	10 \$	19 \$	33 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	35 \$	6 \$	33 \$	13 \$
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	20 \$	1 \$	18 \$	– \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	– \$	– \$	2 \$	26 \$
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	62 \$	– \$	51 \$	– \$
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	16 €	15 €	27 €	– €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	– \$	13 \$	6 \$	69 \$
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	34 €	– €	23 €	– €
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	23 €	– €	22 €	– €
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund [^]	– €	17 €	– €	– €
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^]	637 \$	8 \$	– \$	– \$
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	45 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	8 \$	– \$	– \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	8 \$	40 \$	– \$	– \$
FTGF Putnam Balanced Fund [^]	12 \$	3 \$	– \$	– \$
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	18 \$	36 \$	– \$	– \$

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

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

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

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

Informationsstellengebühr

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

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

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

- 0,15 % p. a. des Nettoinventarwerts des FTGF Western Asset US Core Bond Fund, FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund, FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund, FTGF Western Asset US High Yield Fund, FTGF Western Asset Global High Yield Fund, FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund, FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund, FTGF Western Asset Global Bond Fund[^], FTGF Western Asset Global Credit Fund[^], FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^], 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 – US Fixed Income Fund[^] und FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund;
- 0,35 % p. a. des Nettoinventarwerts des FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund, FTGF ClearBridge US Value Fund, FTGF Putnam US Research Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund[^], FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^], FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^], FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^], FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund, FTGF Putnam US Large Cap Value Fund und FTGF Putnam Global Healthcare Fund; und
- 0,25 % p. a. des Nettoinventarwerts des FTGF Putnam Balanced Fund.

Die Informationsstellengebühren sind für alle Anteilsklassen zahlbar, mit Ausnahme der Anteile der Klasse AX, der Anteile der Klasse D1 und D2 des FTGF Putnam US Research Fund, der Anteilsklassen F, Anteilsklassen J, Anteilsklassen P1 und Anteilsklasse P2, Anteilsklassen Y, Anteilsklassen S, Anteilsklassen LM und Grandfathered Anteilsklassen (jeweils wie im Prospekt definiert). Ebenfalls nicht zahlbar sind diese für alle Anteilsklassen, die vom FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund[^], Franklin Responsible Income 2028 Fund[^], Franklin Responsible Income 2029 Fund[^], FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] und FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund. angeboten werden.

In den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 wurden folgende Informationsstellengebühren erlassen:

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
	Erlassene Informationsstellengebühren	Erlassene Informationsstellengebühren
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	35 \$	19 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	42 \$	22 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	7 \$	3 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	30 \$	32 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	41 \$	47 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	4 \$	1 \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	1 \$	– \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	– \$	4 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	6 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	– \$	1 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	25 \$	12 \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Informationsstellengebühr – (Fortsetzung)

Name des Fonds	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
	Erlassene Informationsstellengebühren	Erlassene Informationsstellengebühren
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	3 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	1 \$	3 \$
FTGF ClearBridge US Value Fund	205 \$	226 \$
FTGF Putnam US Research Fund	170 \$	55 \$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	22 \$	21 \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund [^]	34 \$	38 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	34 \$	34 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	180 \$	217 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	15 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	95 \$	64 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	1 \$	– \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	15 \$	14 \$
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	23 \$	28 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]	– \$	16 \$
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	5 \$	6 \$
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	1 €	– €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	1 \$	4 \$
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	6 \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	17 \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	1 \$	– \$
FTGF Putnam Balanced Fund [^]	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 2026 beliefen sich diese Aufwendungen auf 1.050.476 USD (28. Februar 2025: 1.019.558 \$).

Verbundene Parteien

Verwaltungsrats honorare sind nicht zahlbar für Jaspal Sagger, Craig Tyle und Elinor Murray, die Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, der Anlageverwalter oder ihrer verbundenen Unternehmen sind. 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 2026 und zum 28. Februar 2025 hielten die in der nachfolgenden Tabelle aufgelisteten Fonds Anlagen in Organismen für gemeinsame Anlagen, die dieselben Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter wie die Fonds oder eine verbundene Partei dieser Verwalter, Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter bestellt haben.

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

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	28. Februar 2026 % Wert (in Tsd.)	28. Februar 2025 % Wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,09 %	2.644 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	–	–
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.979 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	653 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,09 %	2.559 \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Franklin Templeton China Funds – Western Asset China Bond Fund – Klasse LM	4,39 %	7.377 \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	–	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,00 %	81 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,73 %	20.876 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3,89 %	111.548 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	1.170 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	837 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,04 %	1.275 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,15 %	4.359 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,21 %	6.138 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,75 %	50.159 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	–	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,03 %	732 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	1.994 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1,87 %	53.733 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,07 %	2.023 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,01 %	157 \$
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Informationsstellengebühr – (Fortsetzung)

Fonds	Zugrunde liegender Organismus für gemeinsame Anlagen	28. Februar 2026 % Wert (in Tsd.)	28. Februar 2025 % Wert (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	0,02 %	510 \$
		0,00 %	5 \$

Etwaige Kreuzbeteiligungen von Fonds sind in Erläuterung 13 zum Abschluss aufgeführt.

Transaktionskosten

Die Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe von Aktien, Organismen für gemeinsame Anlagen, Futures-Kontrakte und Optionen für die Geschäftsjahre zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt:

Name des Fonds	28. Februar 2026 (in Tsd.)	28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	24 \$	30 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	61 \$	139 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	3 \$	7 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	1 \$	1 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	1 \$	– \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	3 \$	2 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	7 \$	10 \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	6 \$	8 \$
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	1 \$	2 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	16 \$	25 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	7 \$	12 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	26 \$	24 \$
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	12 \$	8 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	1 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	85 \$	9 \$
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	1 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	2 \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	30 \$	35 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	2 \$	2 \$
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	93 \$	– \$
FTGF ClearBridge US Value Fund	187 \$	348 \$
FTGF Putnam US Research Fund	398 \$	8 \$
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	58 \$	55 \$
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund [^]	5 \$	13 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	5 \$	5 \$
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	47 \$	85 \$
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	167 \$	23 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	1.293 €	528 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	505 \$	373 \$
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	2 \$	4 \$
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	2.346 \$	2.104 \$
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	82 \$	87 \$
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	6 \$	5 \$
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	14 \$	63 \$
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	60 \$	35 \$
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	23 €	112 €
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	7 \$	17 \$
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	– \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	10 \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	251 \$	– \$
FTGF Putnam Balanced Fund [^]	30 \$	– \$
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	4 \$	– \$

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

Performancegebühr

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

In den Geschäftsjahren zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 fielen keine Performancegebühren an, da keine aktiven (PF) Anteilsklassen in Umlauf waren.

Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren

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

Vergütung der Mitglieder des Verwaltungsrats

Die sich auf das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 beziehenden ergebniswirksam in der Gesamtergebnisrechnung erfassten Honorare und Auslagen der Mitglieder des Verwaltungsrats beliefen sich auf 187.000 USD (28. Februar 2025: 170.000 \$).

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

Prüfungshonorar

Die an den Abschlussprüfer, PricewaterhouseCoopers, für das Geschäftsjahr gezahlten Honorare in Höhe von 967.256 € (ohne MwSt.) beziehen sich auf die gesetzliche Prüfung des Jahresabschlusses der Gesellschaft (28. Februar 2025): 1.019.700 € (ohne MwSt.). Das gesamte Prüfungshonorar für die Gesellschaft, wie in der Gesamtergebnisrechnung auf Seite 183 aufgeführt, enthält die Mehrwertsteuer in Höhe von 23 % und ist in der Berichtswährung der Gesellschaft (US-Dollar) angegeben.

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 beliefen sich die gezahlten Auslagen des Abschlussprüfers auf 12.600 € (28. Februar 2025: 12.600 €).

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 2026	Beteiligung in % 28. Februar 2025
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	78,89	77,26
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	26,67	28,30

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Andere Transaktionen mit verbundenen Parteien – (Fortsetzung)

Fonds	Beteiligung in % 28. Februar 2026	Beteiligung in % 28. Februar 2025
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	22,54	21,92
FTGF Western Asset US High Yield Fund	59,51	40,24
FTGF Western Asset US High Yield Fund	–	33,59
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	50,39	46,49
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	26,05	35,35
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	37,94	30,66
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	20,13	30,32
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	88,29	84,2
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	96,77	66,56
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	–	32,03
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	42,74	30,04
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	97,61	93,06
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	94,15	95,12
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	–	96,88
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	44,70	64,35
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	32,98	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	27,28	40,37
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	52,48	59,35
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	22,71	22,15
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	35,31	33,06
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	–	22,18
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	–	52,03
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	100,00	90,64
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]	100,00	–
FTGF Putnam US Research Fund	–	36,08
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	54,62	28,09
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	55,31	47,99
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	–	38,71
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	–	34,09
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	21,89	27,29
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	–	21,07
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	99,64	100,00
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	25,00	33,48
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	–	99,98
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund [^]	–	61,51
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	–	31,38
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	–	33,72
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	–	30,08
FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]	–	21,69
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	–	39,60
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	–	36,83
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	–	27,90
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^]	28,18	–
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	49,23	–
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	56,75	–
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]	20,83	–
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	23,56	–
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	94,80	–

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

5. Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen

Ausschüttende Anteilsklassen

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

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

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Rentenfonds (wie auf Seite 14 definiert) zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung: -1 Etwaige Nettoanlageerträge werden ganz oder teilweise als Dividende erklärt; und -2 realisierte und nicht realisierte Kapitalgewinne können (müssen aber nicht) abzüglich der realisierten und nicht realisierten Kapitalverluste ganz oder teilweise als Dividende festgesetzt werden.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Aktienfonds (wie auf Seite 14 definiert) werden zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung etwaige Nettoanlageerträge ganz oder teilweise als Dividende erklärt. Für jeden Anteilsinhaber jeder ausschüttenden Anteilsklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilsinhaber verlangt etwas anderes.

Für jede ausschüttende Anteilsklasse jedes Multi-Asset-Fonds (wie auf Seite 14 definiert) werden zum Zeitpunkt jeder Dividendenerklärung etwaige Nettoanlageerträge ganz oder teilweise als Dividende erklärt. Für jeden Anteilsinhaber jeder ausschüttenden Anteilsklasse werden die Ausschüttungen in der Währung vorgenommen, in der der Anteilsinhaber die Anteile gezeichnet hat, es sei denn, der Anteilsinhaber verlangt etwas anderes.

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

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

	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A USD ausschüttend (M) Plus	52 \$	59 \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund – Klasse A AUD ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	3 \$	4 \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Ausschüttende Anteilsklassen – (Fortsetzung)

	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Ausschüttungen aus dem Kapital für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	79 \$	43 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	7 \$	5 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	17 \$	20 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A ZAR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2.522 \$	1.672 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	136 \$	57 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	8 \$	1 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	209 \$	47 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	120 \$	110 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	123 \$	112 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	74 \$	48 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	519 \$	610 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	198 \$	250 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	403 \$	879 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	116 \$	127 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	40 \$	34 \$
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	4 \$	9 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^] – Klasse D USD Ausschüttend (M) Plus	– \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 \$	5 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	538 \$	277 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	21 \$	12 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	26 \$	15 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	40 \$	17 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	43 \$	17 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	137 \$	79 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	547 \$	305 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	53 \$	30 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	55 \$	60 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	22 \$	23 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	2 \$	3 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	6 \$	5 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	15 \$	9 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.742 €	1.137 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1 €	114 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	74 €	67 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	274 €	431 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	104 €	80 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	138 €	113 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1.267 \$	1.124 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	253 \$	173 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	87 \$	39 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	374 \$	187 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	147 \$	142 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	11 \$	17 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus	1.991 \$	1.429 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	2.477 \$	1.759 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	106 \$	104 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) Plus	– \$	3 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse D SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	– \$	1 \$

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

Die von bestimmten Fonds angebotenen Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) Anteilsklassen können bestimmte Gebühren und Aufwendungen dem Kapital statt den Erträgen belasten. Die Anrechnung aller oder eines Teils der Gebühren und Aufwendungen auf das Kapital führt zu einer Erhöhung der ausschüttungsfähigen Erträge; das Kapital, das diesen Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) für künftige Anlagen zur Verfügung steht, und das Kapitalwachstum können sich jedoch verringern. Anteilsinhaber sollten beachten, dass ein erhöhtes Risiko besteht, dass sie bei der Rücknahme von Anteilen der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) nicht den vollen investierten Betrag zurückerhalten. Für Anleger in den Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) kann dies dazu führen, dass die Kapitalanlage des Anlegers ungeachtet der Wertentwicklung des betreffenden Fonds oder der Kapitalgewinne, die dieser ursprünglichen Anlage zuzurechnen sind, aufgezehrt wird, was den Wert künftiger Erträge wahrscheinlich schmälern wird. Die erhöhte Dividendenausschüttung infolge der Belastung des Kapitals mit Gebühren und Kosten kommt einer Rückgabe oder Rücknahme der ursprünglichen Kapitalanlage des Anlegers oder der dieser ursprünglichen Anlage zurechenbaren Kapitalgewinne gleich. Die höhere Dividendenausschüttung im Rahmen dieses Anrechnungsmechanismus führt zu einem entsprechenden unmittelbaren Rückgang des Nettoinventarwerts der Anteilsklassen am Ex-Dividenden-Tag. Anteilsinhaber werden darauf hingewiesen, dass in dem Maße, in dem Aufwendungen dem Kapital belastet werden, einige oder alle Ausschüttungen der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) und Ausschüttend Plus (u) als eine Form der Kapitalrückerstattung angesehen werden sollten. Alle Kosten der Anteilsklassen Ausschüttend Plus (e) wurden dem Kapital belastet.

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

	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	2 \$	3 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	113 \$	194 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	19 \$	42 \$
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund – Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	253 \$	794 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	847 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A AUD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	99 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A CNH Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	13 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	30 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	61 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A JPY Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	3 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	147 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	18 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	8 \$
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	81 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

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

Ausschüttende Anteilsklassen – (Fortsetzung)

	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Dem Kapital belastete Gebühren und Aufwendungen für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	745 \$	1.117 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	321 \$	404 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	53 \$	69 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse A SGD Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	278 \$	305 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	88 \$	99 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	13 \$	43 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	10 \$	14 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	46 \$	75 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	118 \$	152 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	10 USD	10 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	17 \$	20 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	19 \$	1 \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	99 \$	159 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (M) (abgesichert) Plus (e)	1 \$	1 \$
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (abgesichert) (PH) Plus (e)	412 €	391 €
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (abgesichert) (PH) Plus (e)	24 €	26 €
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	488 \$	758 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	8 \$	– \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	12 \$	15 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	22 \$	7 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (abgesichert) Plus (e)	5 \$	3 USD
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	89 \$	36 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	2 \$	2 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	16 \$	1 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	22 \$	7 \$
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	197 \$	19 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	23 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	2 \$
FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^] – Klasse P1 GBP Ausschüttend (M) Plus (e)	– \$	1 \$
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^] – Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	– \$	– \$

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

Thesaurierende Anteilsklassen

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

6. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigten Anteile

Grundkapital

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

Rückkaufbare und gewinnberechtigten Anteile

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

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

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

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

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

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

Anteile der Klasse A und der Klasse A1 stehen allen Anlegern zur Verfügung. Provisions-/Rückvergütungszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile getroffen haben. Anteile der Klasse AX stehen allen Anlegern zur Verfügung. Nach der jeweiligen Erstzeichnungsfrist entspricht der Zeichnungspreis je Anteil dem nächstfolgend ermittelten NIW je Anteil zuzüglich eines Ausgabeaufschlags von bis zu 1,5 %. Anteile der Klassen B, C, D, E und K stehen allen Anlegern zur Verfügung, die Kunden von Händlern sind, die von einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Anteile bestellt wurden. Provisionszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die eine Vereinbarung mit einer Vertriebsstelle in Bezug auf diese Aktien getroffen haben. Anteile der Klasse F stehen professionellen Anlegern und Anlegern zur Verfügung, die mit einem von der Vertriebsstelle bestellten Händler eine Vereinbarung über die Anlage dieser Anteile nach eigenem Ermessen getroffen haben. Provisions-/Rückvergütungszahlungen können von Vertriebsstellen an Händler oder andere Anleger geleistet werden, die mit der Vertriebsstelle eine Vereinbarung in Bezug auf diese Aktien getroffen haben. Anteile der Klasse J sind für den Vertrieb in Japan bestimmt, der im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen liegt. Beim FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund stehen Anteile der Klasse M professionellen Anlegern und Anlegern zur Verfügung, die mit einem Händler oder einer anderen von einer Vertriebsstelle für diese Anteile bestellten Stelle eine Vereinbarung über die Anlage nach eigenem Ermessen getroffen haben. Bei allen anderen Fonds stehen Anteile der Klasse M professionellen Anlegern, Plattformen,

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

6. Grundkapital und rückkaufbare gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile – (Fortsetzung)

die keine Vertriebsprovisionen annehmen und einbehalten dürfen, sowie Anlegern, die mit einem Händler oder einer anderen von einer Vertriebsstelle für diese Anteile bestellten Stelle eine Vereinbarung über die Anlage nach eigenem Ermessen getroffen haben, zur Verfügung. Anteile der Klasse R stehen allen Anlegern zur Verfügung, die eine gebührenbasierte Vereinbarung mit einem Vermittler getroffen haben, von dem sie eine persönliche Empfehlung in Bezug auf ihre Anlage in den Fonds erhalten haben. Anteile der Klasse S stehen einem Anleger zur Verfügung, der eine Mindestanlage von mindestens 50.000.000 USD in den betreffenden Teilfonds tätigt, es sei denn, der Anleger erfüllt eines der folgenden Kriterien: i) insgesamt mindestens 1.000.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung), die in Organismen für gemeinsame Anlagen von Franklin Templeton, die in der EU domiziliert sind, investiert sind oder für die (mittels einer Absichtserklärung) eine Verpflichtung eingegangen wurde; und/oder ii) insgesamt mindestens 5.000.000.000 USD (oder Gegenwert in einer anderen Währung) an Vermögenswerten, die von Franklin Templeton global verwaltet werden oder für die (im Rahmen einer Absichtserklärung) eine entsprechende Verpflichtung besteht; wobei die unter i) oder ii) genannten zulässigen institutionellen Anleger keine Provisionen, Rabatte oder andere ähnliche Gebühren (als Anreize bezeichnet) erhalten und einbehalten dürfen. Anteile der Klasse T sind für den Vertrieb in Taiwan bestimmt, der im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen liegt. Anteile der Klasse T2 stehen im Ermessen des Verwaltungsrats auch für den Vertrieb in Europa zur Verfügung. Anteile der Klasse T0 stehen im Ermessen des Verwaltungsrats für italienische Vertriebsstellen zur Verfügung. Anteile der Klasse T des Fonds stehen Anlegern zur Verfügung, die von einem Vermittler Anlageberatung erhalten und zugestimmt haben, dass dieser Vermittler gegebenenfalls Provisionen, Rabatte oder Retrozessionen erhält. Für bestimmte Anteilsklassen ist eine Platzierungsgebühr zu entrichten. Die Platzierungsgebühr wird für die Vergütung der Vertriebsstelle verwendet. Bei der Emission wird ein Betrag in Höhe der geltenden Platzierungsgebühr zurückgestellt (erhoben auf den Anlagebetrag) und über einen Zeitraum von drei Jahren durch tägliche Abzüge mit linearer Abschreibung abgeschrieben. Anteile der Klasse X stehen Händlern, Portfoliomanagern oder Plattformen zur Verfügung, die gemäß den aufsichtsrechtlichen Bestimmungen oder aufgrund von Gebührenvereinbarungen mit ihren Kunden keine Vertriebsprovisionen annehmen und einbehalten dürfen, sowie institutionellen Anlegern (für Anleger in der Europäischen Union bedeutet dies „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II), die für eigene Rechnung investieren. Anteile der Klasse Y stehen institutionellen Anlegern nach Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen zur Verfügung. BW LM-Anteilsklassen stehen im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe sind oder Kunden dieser Unternehmen sind. LM-Anteilsklassen stehen im Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen qualifizierten Anlegern zur Verfügung, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe, Altersversorgungssysteme und ähnliche Systeme, die von Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden dieser Unternehmen gesponsert werden, sind. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union sind BW Premier-Anteilsklassen nach dem Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II erhältlich; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union sind BW Premier-Anteilsklassen nach dem Ermessen des Verwaltungsrats oder der Vertriebsstellen für institutionelle Anleger oder für qualifizierte Anleger erhältlich, die Unternehmen der Franklin Templeton-Gruppe oder Kunden dieser Unternehmen sind. Für Anleger mit Sitz in der Europäischen Union sind Premier-Anteilsklassen für „zulässige Gegenparteien“ im Sinne von MIFID II verfügbar; für Anleger mit Sitz außerhalb der Europäischen Union sind Premier-Anteilsklassen für institutionelle Anleger verfügbar.

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

Auf Rücknahmeerlöse, die an einen Anteilsinhaber ausgezahlt werden, der Anteile der Klassen AX, B, C, B (G) USD Ausschüttend (D), B (G) USD Ausschüttend (A), B (G) USD Thesaurierend, L (G) USD Ausschüttend (D), L (G) USD Ausschüttend (A), L (G) USD Ausschüttend (A), L (G) USD Thesaurierend, T oder K zurückgibt, kann eine bedingte Rücknahmegebühr („CDSC“) erhoben werden.

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

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

7. Besteuerung

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

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

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

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

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

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

8. Barmittel und Barmitteläquivalente und Margenkonten

Barmittel und andere liquide Mittel werden zum Nennwert und gegebenenfalls unter Berücksichtigung aufgelaufener Zinsen bewertet. Die Barmittel und Barmitteläquivalente und Barmittel-Überziehungssalden eines Fonds werden bei der Depotstelle gehalten. „Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung“ in der Bilanz umfassen Einschusszahlungen, Barsicherheiten und realisierte Gewinne und Verluste aus noch nicht gelieferten Futures-Kontrakten. Zum 28. Februar 2026 wurden Einschusszahlungen und Barsicherheiten in Bezug auf den Handel mit OTC- und börsengehandelten Derivaten bei den folgenden Brokern gehalten: Bank of America Merrill Lynch, BNP Paribas, Citi, Goldman Sachs, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS (28. Februar 2025: Bank of America Merrill Lynch, Barclays, BNY, Citi, Goldman Sachs, HSBC, JP Morgan, Morgan Stanley und UBS).

9. Verpflichtungen und Eventualverbindlichkeiten

Zum 28. Februar 2026 bzw. 28. Februar 2025 bestanden keine wesentlichen Verbindlichkeiten oder Eventualverbindlichkeiten.

10. Soft-Commission-Vereinbarungen

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

Während des Berichtsjahres zum 28. Februar 2026 schlossen Royce & Associates, LP („Royce“) und The Putnam Advisory Company, LLC („Putnam“) Soft-Commission-Verträge mit Brokern, erstatteten den betreffenden Fonds jedoch die im Rahmen dieser Verträge angefallenen Research-Kosten (28. Februar 2025: Royce).

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

11. Wechselkurse

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

	Währung	Wechselkurse zum 28. Februar 2026	Wechselkurse zum 28. Februar 2025
Auf USD lautende Fonds	Argentinischer Peso	1.461,2692*	1.221,8909
	Australischer Dollar	1,4052	1,6116
	Brasilianischer Real	5,1265	5,8877
	Britisches Pfund	0,7420	0,7950
	Kanadischer Dollar	1,3641	1,4468
	Chilenischer Peso	872,7200	959,9100
	Chinesischer Renminbi (CNH)	6,8609	7,2952
	Chinesischer Renminbi (CNY)	6,8557	7,2832
	Kolumbianischer Peso	3.752,0000	4.153,8200
	Tschechische Krone	20,5082	24,1842
	Dänische Krone	6,3236	7,1894
	Ägyptisches Pfund	47,9500	50,6500
	Euro	0,8463	0,9640
	Hongkong-Dollar	7,8234	7,7771
	Ungarischer Forint	318,9108	388,4419
	Indische Rupie	90,9763	87,5038
	Indonesische Rupiah	16.765,0000	16.580,0000
	Israelischer Schekel	/	3,6084
	Jamaika-Dollar	156,0000	157,5000
	Japanischer Yen	156,1650	150,5350
	Malaysischer Ringgit	3,8910	4,4625
	Mexikanischer Peso	17,2220	20,5540
	Neuseeland-Dollar	1,6671	1,7868
	Norwegische Krone	9,5083	11,2633
	Peruanischer Nuevo Sol	3,3550	/
	Philippinischer Peso	57,6650	57,9925
	Polnischer Zloty	3,5732	4,0452
	Russischer Rubel	77,3000	89,3750
	Saudi-Rial	3,7509	3,7503
	Singapur-Dollar	1,2649	1,3515
	Südafrikanischer Rand	15,9238	18,7100
	Südkoreanischer Won	1.438,5000	1.462,9000
	Schwedische Krone	9,0276	10,7671
	Schweizer Franken	0,7689	0,9030
	Taiwan-Dollar	31,2110	32,8125
	Thailändischer Baht	31,0850	34,1725
	Türkische Lira	43,9340	36,4848
	Dirham der Vereinigten Arabischen Emirate	/	3,6728
	Uruguayischer Peso	38,4550	/
Auf EUR lautende Fonds	Australischer Dollar	1,6604	1,6718
	Brasilianischer Real	6,0575	6,1076
	Britisches Pfund	0,8768	0,8247
	Kanadischer Dollar	1,6118	1,5008
	Chinesischer Renminbi (CNH)	8,1068	7,5677
	Dänische Krone	/	7,4579
	Singapur-Dollar	1,4946	1,4019
	Schwedische Krone	/	11,1693
	Schweizer Franken	/	0,9367
	US-Dollar	1,1816	1,0374

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

12. Risikoexposition und Risikomanagement

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

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 von einem Fonds gehaltenen Wertpapiere bei Zinsänderungen, bedeutet dies, dass der Nettoinventarwert je Anteil aufgrund der Auswirkung auf den Wert des aus Schuldtiteln bestehenden Fondsportfolios sinken oder steigen kann.

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

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

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

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

12.1 Marktrisiko

Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt, ist bestrebt, das Marktrisiko und die Hebelwirkung, die durch den Einsatz von Derivaten entstehen, zu begrenzen, indem er entweder den Commitment-Ansatz oder ein komplexes Verfahren zur Risikomessung („Value-at-Risk“- bzw. „VaR“-Ansatz“) anwendet. Jeder Fonds, der Finanzderivate einsetzt (außer der FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] und FTGF Putnam Global Healthcare Fund) wendet den Commitment-Ansatz an. Der FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund und FTGF Putnam Global Healthcare Fund wenden den VaR-Ansatz an. Der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] wendete bis zur Einstellung des Handels am 4. August 2025 den VaR-Ansatz an.

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

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

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

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

Fonds	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	0,55 %	0,71 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	0,18 %	0,30 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	0,17 %	0,96 %

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

Fonds	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	0,50 %	0,55 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	0,32 %	0,48 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	/	0,30 %

The Putnam Advisory Company, LLC („Putnam“) berechnet den VaR mit einem Konfidenzniveau von 99 % für einen Zeithorizont von 1 Tag unter Verwendung einer geeigneten Stichprobe historischer Daten. Die nachstehende Tabelle gibt den absoluten VaR für die Fonds an:

Fonds	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	1,93 %	/

Der FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Series Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund und FTGF Putnam Global Healthcare Fund wenden bzw. der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] wendete (bis zum Datum seiner Schließung) ein „absolutes“ VaR-Modell gemäß den Vorschriften der Zentralbank an, wobei jeder dieser Fonds einer absoluten VaR-Grenze von 20 % des Nettoinventarwerts des Fonds unterliegt bzw. unterlag. Bei jedem dieser Fonds kann jedoch von Zeit zu Zeit eine Veränderung des Nettoinventarwerts über einen Zeitraum von 20 Tagen von mehr als 20 % des Nettoinventarwerts eintreten bzw. eingetreten sein.

Neben der Anwendung des VaR-Ansatzes überwacht der Manager des 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[^] und FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund und FTGF Putnam Global Healthcare Fund bzw. überwachte der Manager des FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] (bis zum Datum der Schließung) täglich die Höhe der Hebelfinanzierung, um Veränderungen aufgrund von Marktbewegungen zu überwachen.

Darüber hinaus führen die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter jedes dieser Fonds im Vorfeld von Transaktionen Tests durch, um zu prüfen, wie sich die Transaktion auf die Gesamthebelwirkung des betreffenden Fonds auswirken würde, und um dem Risiko-Ertrags-Verhältnis der Transaktion Rechnung zu tragen.

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

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026

Fonds	Minimum	Durchschnitt	Maximum
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	3,07 %	4,10 %	5,32 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	1,14 %	1,54 %	2,19 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	2,65 %	4,02 %	5,64 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	2,46 %	3,76 %	5,31 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	2,04 %	2,82 %	3,54 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund ^{^*}	0,05 %	5,07 %	7,39 %
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	8,57 %	9,16 %	9,78 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025

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

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 2026	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025
FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]	/	966,85 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	36,09 %	58,36 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	15,59 %	23,06 %
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund [^]	289,73 %	277,34 %
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]	191,35 %	153,57 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	33,06 %	31,71 %
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^] *	3,71 %	6,86 %
FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund [^]	/	104,95 %
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	/	36,42 %
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	0,00 %	/

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

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

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

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund
Zum 28. Februar 2026	-414.548 \$
Zum 28. Februar 2025	-379.240 \$

(a) Marktpreisrisiko

Das Marktpreisrisiko jedes Fonds in Bezug auf einen Index wird überwacht, jedoch nicht gemanagt. Die Indizes zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 sind unten aufgeführt.

In den folgenden Tabellen ist für jeden Fonds der Index angegeben, außer für den FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^], FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^], Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^], FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^], FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] und FTGF Putnam Global Healthcare Fund, ebenso wie die wahrscheinliche Auswirkung auf den Wert des Nettoinventarwerts für jeden Fonds auf der Grundlage positiver und negativer Entwicklungen im Index, einschließlich des 1-Jahres-Betas für jeden Fonds. Beta ist ein Maß für die Volatilität der Bestände eines Fonds im Verhältnis zum Markt oder Index. Das Beta ist zwar ein klares, quantifizierbares Maß, berücksichtigt aber keine neuen Informationen, und vergangene Kursbewegungen sind keine genauen Vorhersagen für die Zukunft.

Zum 28. Februar 2026

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 %*	Negativ 5 %*
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month	USD	5.727	-5.727
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	4.231	-4.231
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	9.778	-9.778
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	50 % Bloomberg Global Aggregate Index (Gross-Hgd) (USD)/25 % Bloomberg US Corporate High Yield Index (Gross) (USD)/25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Gross) (USD)	USD	5.016	-5.016
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	4.467	-4.467
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index (Hedged) USD	USD	2.009	-2.009
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	6.931	-6.931
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund ***	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	316	-316
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index (Hedged) USD	USD	5.735	-5.735
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index (Hedged) USD	USD	524	-524
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	71.533	-71.533
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index (USD Hedged)	USD	1.575	-1.575
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	ICE BofA Global High Yield Index	USD	3.725	-3.725
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	FTSE World Government Bond Index	USD	12.586	-12.586
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Bloomberg U.S. Aggregate	USD	1.507	-1.507
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^] ****	MSCI AC World Net Index	USD	/	/
FTGF ClearBridge US Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	41.034	-41.034
FTGF Putnam US Research Fund	S&P 500 Net Index	USD	74.600	-74.600
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	58.331	-58.331
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.110	-1.110
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Russell 3000 Index	USD	29.609	-29.609
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	MSCI AC World Net Index	USD	12.491	-12.491

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 % *	Negativ 5 % *
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	-413.179	413.179
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	-134.287	134.287
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]	MSCI World Value Net Index	USD	363	-363
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	65.950	-65.950
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	5.110	-5.110
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	300	-300
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.066	-1.066
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] ***	30 % Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70 % Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	1.630	-1.630
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^] ***	30 % Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70 % Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	1.425	-1.425
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund [^] ***	30 % Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70 % Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	/	/
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund [^] ****	ICE BofA US Treasury Bill	USD	/	/
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^] ****	ICE BofA Global High Yield Investment Grade Country Constrained Index	USD	/	/
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^] ****	Russell 1000 Growth Index	USD	/	/
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^] ****	Russell 1000 Value Index	USD	/	/
FTGF Putnam Balanced Fund [^] ****	60 % S&P 500 Index, 40 % Bloomberg US Aggregate Index	USD	/	/

Zum 28. Februar 2025

Fonds	Index	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Veränderungen im Index (in Tsd.)	
			Positiv 5 % *	Negativ 5 % *
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	FTSE Treasury Bill 1-Month	USD	28.210	-28.210
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	5.427	-5.427
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bloomberg U.S. Aggregate Bond Index	USD	13.628	-13.628
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	50 % Bloomberg Global Aggregate Index (Gross-Hedged) (USD) / 25 % Bloomberg US Corporate High Yield Index (Gross) (USD) / 25 % JP Morgan EMBI Global Diversified Index (Gross) (USD), davor ICE BofA US Dollar 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity	USD	10.937	-10.937
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Bloomberg U.S. Corporate High Yield Bond Index 2 % Issuer Capped	USD	4.571	-4.571
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Bloomberg Global High Yield Index Currency Hedged (USD)	USD	2.417	-2.417
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Markit iBoxx Asian Local Bond Index	USD	9.048	-9.048
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund ***	ICE BofA U.S. Treasury 1-10 Years Index	USD	4.261	-4.261
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Index Currency Hedged (USD)	USD	7.302	-7.302
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Bloomberg Global Aggregate Credit Index Currency Hedged (USD)	USD	1.344	-1.344
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Bloomberg U.S. Mortgage Backed Securities Index	USD	61.637	-61.637
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index (CH in USD), davor FTSE World Govt Bond Index (USD)	USD	4.330	-4.330
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Bloomberg Global High Yield Index	USD	1.795	-1.795
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund	FTSE World Government Bond Index	USD	13.141	-13.141
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Bloomberg U.S. Aggregate	USD	2.248	-2.248
FTGF ClearBridge US Value Fund	Russell 1000 Value Index	USD	56.554	-56.554
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund	S&P 500 Index	USD	9.081	-9.081
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Russell 1000 Growth Index	USD	90.390	-90.390
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund	Russell Midcap Growth NR (USD), davor Russell 3000 Growth (USD) Index	USD	5.866	-5.866
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Dow Jones U.S. Select Dividend Index (Total)	USD	1.081	-1.081
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Russell 3000 Index	USD	45.373	-45.373
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	MSCI AC World Net Index	USD	1.467	-1.467
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	EUR	34.101	-34.101
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	OECD G7 CPI + 5,5 %. VPI: Consumer Price Index (Inflation)	USD	31.732	-31.732
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund [^]	MSCI World Value Net Index	USD	276	-276
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Russell 2000 Value Index	USD	50.524	-50.524
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Russell 2000 Index	USD	4.159	-4.159
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	MSCI AC World Index Small Cap Net Index	USD	252	-252
FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund [^]	MSCI AC World Net Index	USD	1.383	-1.383
FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund [^]	MSCI Emerging Markets Net Index	USD	1.474	-1.474
FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund [^]	MSCI Europe Net Index	EUR	5.229	-5.229
FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^] **	Benchmark nicht verfügbar	USD	/	/
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^] ***	30 % Bloomberg Euro High Yield 3-5 Yr + 70 % Bloomberg Euro Corporate 3-5 Yr	EUR	4.052	-4.052
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^] ****	Benchmark nicht verfügbar	EUR	/	/

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(a) Marktpreisrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

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

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

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

Die Sensitivitätsanalyse für das Marktpreisrisiko für den FTGF Western Asset 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[^] (für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025, da dieser Fonds den Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2026 einstellte) und FTGF Putnam Global Healthcare Fund wurde in die Berechnung des Marktrisikos unter Anwendung des VaR-Ansatzes einbezogen (Erläuterung 12.1 oben).

(b) Fremdwährungsrisiko

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

In den folgenden Tabellen ist das Nettoengagement der Fonds im Fremdwährungsrisiko zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 angegeben.

Bei den unten aufgeführten Beträgen handelt es sich überwiegend um monetäre Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, mit Ausnahme von Anlagen in nicht zinstragenden Wertpapieren, bei denen es sich um nichtmonetäre Vermögenswerte handelt, einschließlich Aktien, börsengehandelter Fonds und Organismen für gemeinsame Anlagen. Die unten aufgeführten Beträge für Devisenterminkontrakte stellen die Werte dar, die im Rahmen von Währungsverträgen eingehen und beinhalten Devisensicherungsgeschäfte. Die Beträge für die sonstigen Derivate stellen die nicht realisierte Wertsteigerung/-minderung zum Jahresende dar.

Zum 28. Februar 2026

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
US-Dollar	\$ 1.418.168	\$ 649.898	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -300	\$ 2.067.766
Gesamtbetrag	\$ 1.418.168	\$ 649.898	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -300	\$ 2.067.766
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
US-Dollar	\$ 53.404	\$ 22.231	\$ 2.644	\$ –	\$ 98	\$ -75	\$ 78.302
Gesamtbetrag	\$ 53.404	\$ 22.231	\$ 2.644	\$ –	\$ 98	\$ -75	\$ 78.302
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 591	\$ 11	\$ 52	\$ 654
Brasilianischer Real	1.353	–	–	-2.449	33	1.557	494
Britisches Pfund	–	–	–	-229	11	304	86
Kanadischer Dollar	–	–	–	-131	–	131	–
Chilenischer Peso	229	–	–	–	–	5	234
Tschechische Krone	233	–	–	–	–	2	235
Euro	–	–	–	568	–	322	890
Indische Rupie	850	–	–	-871	–	24	3
Japanischer Yen	–	–	–	-445	–	428	-17
Malaysischer Ringgit	233	–	–	–	–	32	265
Peruanischer Nuevo Sol	107	–	–	–	–	–	107
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	17	17
Südafrikanischer Rand	237	–	–	–	–	1	238
US-Dollar	124.264	48.920	11	2.765	148	-2.680	173.428
Uruguayischer Peso	108	–	–	–	–	2	110
Gesamtbetrag	\$ 127.614	\$ 48.920	\$ 11	\$ -201	\$ 203	\$ 197	\$ 176.744
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.817	\$ –	\$ –	\$ 1.817
Brasilianischer Real	2.036	–	–	-1.992	–	191	235
Britisches Pfund	10.796	9.001	–	-20.768	-14	801	-184
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	2	2
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.544	–	–	-2.544
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	82	82
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	41	41
Euro	36.551	9.337	45	-28.007	-756	1.854	19.024
Indische Rupie	2.015	–	–	-1.969	–	67	113
Japanischer Yen	581	–	–	3.316	–	3	3.900
Mexikanischer Peso	4.965	–	–	-4.618	–	534	881
Polnischer Zloty	2.731	–	–	2.422	–	103	5.256
Singapur-Dollar	–	–	–	630	–	–	630
Südafrikanischer Rand	4.217	–	–	15.393	–	226	19.836
Schweizer Franken	–	–	–	71.354	–	–	71.354
Taiwan-Dollar	–	–	–	-1.526	–	–	-1.526
US-Dollar	66.079	27.931	14	-33.858	-38	8.391	68.519
Gesamtbetrag	\$ 129.971	\$ 46.269	\$ 59	\$ -350	\$ -808	\$ 12.295	\$ 187.436

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 33	\$ –	\$ –	\$ 33
Euro	–	–	205	1.589	–	1	1.795
Singapur-Dollar	–	–	–	8.086	–	-192	7.894
US-Dollar	64.267	12.902	2.086	-9.730	33	396	69.954
Gesamtbetrag	\$ 64.267	\$ 12.902	\$ 2.291	\$ -22	\$ 33	\$ 205	\$ 79.676
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.328	\$ –	\$ –	\$ 3.328
Britisches Pfund	268	651	–	263	–	22	1.204
Euro	2.121	112	112	3.018	–	52	5.415
Hongkong-Dollar	–	–	1	–	–	-1	–
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	81	81
Singapur-Dollar	–	–	–	2.920	–	-208	2.712
US-Dollar	28.451	6.802	181	-9.513	-24	122	26.019
Gesamtbetrag	\$ 30.840	\$ 7.565	\$ 294	\$ 16	\$ -24	\$ 68	\$ 38.759
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 9.953	\$ –	\$ -1	\$ 9.952
Chinesischer Renminbi	26.917	–	–	15.880	–	621	43.418
Euro	–	–	–	294	–	-1	293
Hongkong-Dollar	1.062	–	–	–	–	-2	1.060
Indische Rupie	17.111	–	–	–	–	290	17.401
Indonesische Rupiah	10.077	–	–	–	–	98	10.175
Malaysischer Ringgit	16.562	–	–	–	–	205	16.767
Neuseeland-Dollar	–	–	–	-2.522	–	–	-2.522
Philippinischer Peso	9.591	–	–	-2.718	–	77	6.950
Singapur-Dollar	8.718	4.764	–	4.444	–	122	18.048
Südkoreanischer Won	15.223	–	–	–	28	390	15.641
Thailändischer Baht	10.841	–	–	–	–	64	10.905
US-Dollar	–	–	653	-25.168	–	-515	-25.030
Gesamtbetrag	\$ 116.102	\$ 4.764	\$ 653	\$ 163	\$ 28	\$ 1.348	\$ 123.058
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Britisches Pfund	\$ 16.675	\$ 5.407	\$ –	\$ 37.774	\$ -14	\$ 1.012	\$ 60.854
Euro	90.634	10.435	–	-96.496	-677	3.373	7.269
Schwedische Krone	–	–	–	3.812	–	1	3.813
Schweizer Franken	–	–	–	5.104	–	–	5.104
US-Dollar	44.141	11.496	2.559	48.833	-108	-1.834	105.087
Gesamtbetrag	\$ 151.450	\$ 27.338	\$ 2.559	\$ -973	\$ -799	\$ 2.552	\$ 182.127
FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 678	\$ 44	\$ 247	\$ 969
Brasilianischer Real	2.329	–	–	-2.316	–	14	27
Britisches Pfund	7.093	150	–	-7.451	-9	378	161
Kanadischer Dollar	2.132	–	–	75.562	–	167	77.861
Chinesischer Renminbi	173	–	–	-9.014	–	–	-8.841
Euro	17.480	3.137	–	-21.148	-5	787	251
Indonesische Rupiah	238	–	–	-243	–	13	8
Japanischer Yen	10.055	–	–	-9.602	9	268	730
Mexikanischer Peso	1.626	–	–	-1.487	–	34	173
Norwegische Krone	1.907	–	–	-602	–	42	1.347
Polnischer Zloty	1.137	–	–	-288	–	20	869
Südafrikanischer Rand	2.316	–	–	-2.272	–	101	145
Südkoreanischer Won	4.156	–	–	-4.304	–	66	-82
Schwedische Krone	–	–	–	-23	–	–	-23
US-Dollar	28.589	7.507	7.377	-18.225	24	-843	24.429
Gesamtbetrag	\$ 79.231	\$ 10.794	\$ 7.377	\$ -735	\$ 63	\$ 1.294	\$ 98.024
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 137	\$ 206	\$ –	\$ -475	\$ 2	\$ 39	\$ -91
Kanadischer Dollar	–	–	–	-5	–	–	-5
Euro	3.754	795	–	-4.864	-59	541	167
Japanischer Yen	34	–	–	-44	–	11	1
US-Dollar	3.753	1.215	81	5.352	-6	-38	10.357
Gesamtbetrag	\$ 7.678	\$ 2.216	\$ 81	\$ -36	\$ -63	\$ 553	\$ 10.429

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 790	\$ 47	\$ 195	\$ 1.032
Brasilianischer Real	1.442	–	–	-1.492	-491	586	45
Britisches Pfund	1.198	2.063	–	253.046	20	178	256.505
Kanadischer Dollar	–	–	–	18.415	–	905	19.320
Euro	199	485	306	12.238	28	160	13.416
Indische Rupie	2.169	–	–	-2.193	–	62	38
Jamaika-Dollar	204	–	–	–	–	6	210
Japanischer Yen	–	–	–	24.729	–	–	24.729
Mexikanischer Peso	1.014	–	–	-1.563	434	204	89
Schweizer Franken	–	–	–	4.573	–	–	4.573
Türkische Lira	–	–	–	–	–	1	1
US-Dollar	195.354	112.119	132	-312.926	257	22.743	17.679
Gesamtbetrag	\$ 201.580	\$ 114.667	\$ 438	\$ -4.383	\$ 295	\$ 25.040	\$ 337.637
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.563	\$ –	\$ –	\$ 1.563
Schweizer Franken	–	–	–	87	–	–	87
US-Dollar	152.811	344.582	32.213	-1.664	-452	-360	527.130
Gesamtbetrag	\$ 152.811	\$ 344.582	\$ 32.213	\$ -14	\$ -452	\$ -360	\$ 528.780
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.152.919	\$ 113.749	\$ 111.548	\$ –	\$ 49	\$ -133.209	\$ 1.245.056
Gesamtbetrag	\$ 1.152.919	\$ 113.749	\$ 111.548	\$ –	\$ 49	\$ -133.209	\$ 1.245.056
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 104	\$ 5	\$ 9	\$ 118
Brasilianischer Real	97	–	–	-74	-2	36	57
Britisches Pfund	–	–	–	-403	5	63	-335
Kanadischer Dollar	–	–	–	-11	–	11	–
Tschechische Krone	55	–	–	–	–	–	55
Euro	–	–	–	34	–	20	54
Indische Rupie	224	–	–	–	–	6	230
Malaysischer Ringgit	54	–	–	–	–	1	55
Mexikanischer Peso	54	–	–	–	–	1	55
Peruanischer Nuevo Sol	24	–	–	–	–	–	24
Südafrikanischer Rand	55	–	–	–	–	1	56
US-Dollar	14.698	1.902	1.171	348	66	18	18.203
Gesamtbetrag	\$ 15.261	\$ 1.902	\$ 1.171	\$ -2	\$ 74	\$ 166	\$ 18.572
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 6.146	\$ –	\$ –	\$ -4.762	\$ –	\$ 70	\$ 1.454
Britisches Pfund	6.247	–	–	2.721	–	145	9.113
Kanadischer Dollar	777	–	–	–	–	–	777
Chilenischer Peso	–	–	–	813	–	–	813
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-880	–	–	-880
Kolumbianischer Peso	1.509	–	–	-1.557	–	106	58
Euro	–	–	–	11.591	–	1	11.592
Ungarischer Forint	265	–	–	-128	–	6	143
Indische Rupie	1.676	–	–	-1.666	–	3	13
Japanischer Yen	1.451	–	–	-277	–	14	1.188
Mexikanischer Peso	1.788	–	–	-1.910	–	59	-63
Neuseeland-Dollar	–	–	–	650	–	–	650
Norwegische Krone	947	–	–	–	–	1	948
Südkoreanischer Won	–	–	–	1.134	–	–	1.134
US-Dollar	–	25.966	837	-6.321	–	-811	19.671
Gesamtbetrag	\$ 20.806	\$ 25.966	\$ 837	\$ -592	\$ –	\$ -406	\$ 46.611

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ 2.952	\$ –	\$ –	\$ 3.451	\$ 40	\$ 40	\$ 6.483
Brasilianischer Real	5.103	–	–	–	–	44	5.147
Britisches Pfund	–	–	–	156	70	1	227
Kanadischer Dollar	–	–	–	-2.359	-23	1	-2.381
Chilenischer Peso	–	–	–	939	–	–	939
Kolumbianischer Peso	2.015	–	–	-1.212	–	-115	688
Ägyptisches Pfund	4.698	–	–	947	–	–	5.645
Euro	–	–	–	-9.158	–	–	-9.158
Ungarischer Forint	497	–	–	–	–	12	509
Japanischer Yen	–	–	–	4.634	–	-1	4.633
Mexikanischer Peso	3.771	–	–	-3.906	–	148	13
Neuseeland-Dollar	–	–	–	1.192	–	–	1.192
Norwegische Krone	–	–	–	2.513	–	–	2.513
Südafrikanischer Rand	–	–	–	1.422	–	–	1.422
Südkoreanischer Won	–	–	–	9.503	–	–	9.503
Schwedische Krone	–	–	–	-1.417	–	–	-1.417
Schweizer Franken	–	–	–	-9.559	–	–	-9.559
US-Dollar	6.903	18.572	1.275	2.919	-112	1.009	30.566
Gesamtbetrag	\$ 25.939	\$ 18.572	\$ 1.275	\$ 65	\$ -25	\$ 1.139	\$ 46.965
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 694	\$ –	\$ –	\$ -34	\$ –	\$ 12	\$ 672
Kanadischer Dollar	–	–	–	19.272	–	–	19.272
Euro	720	–	–	16.446	–	6	17.172
US-Dollar	61.241	1.500	4.359	-35.640	27	1.229	32.716
Gesamtbetrag	\$ 62.655	\$ 1.500	\$ 4.359	\$ 44	\$ 27	\$ 1.247	\$ 69.832
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ 24.901	\$ –	\$ –	\$ -2.476	\$ –	\$ 284	\$ 22.709
Brasilianischer Real	18.256	–	–	–	–	89	18.345
Britisches Pfund	25.410	–	–	-24.899	–	318	829
Kanadischer Dollar	–	–	–	4.580	–	–	4.580
Chilenischer Peso	–	–	–	16.679	–	–	16.679
Chinesischer Renminbi	–	–	–	5.159	–	–	5.159
Kolumbianischer Peso	8.388	–	–	-4.994	–	-608	2.786
Dänische Krone	–	–	–	-30	–	–	-30
Ägyptisches Pfund	10.242	–	–	3.428	–	–	13.670
Euro	–	–	–	-4.281	–	–	-4.281
Ungarischer Forint	2.038	–	–	–	–	49	2.087
Indische Rupie	7.119	–	–	-6.810	–	12	321
Israelischer Schekel	–	–	–	-60	–	–	-60
Japanischer Yen	6.084	–	–	29.158	–	58	35.300
Mexikanischer Peso	13.278	–	–	-13.279	–	448	447
Neuseeland-Dollar	–	–	–	21.223	–	–	21.223
Norwegische Krone	–	–	–	6.052	–	–	6.052
Polnischer Zloty	–	–	–	-107	–	–	-107
Singapur-Dollar	–	–	–	-56	–	1	-55
Südkoreanischer Won	–	–	–	27.629	–	–	27.629
Schwedische Krone	–	–	–	-27	–	–	-27
US-Dollar	18.544	60.578	6.138	-56.715	–	-2.574	25.971
Gesamtbetrag	\$ 134.260	\$ 60.578	\$ 6.138	\$ 174	\$ –	\$ -1.923	\$ 199.227
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 4.008	\$ –	\$ –	\$ 4.008
Brasilianischer Real	46.515	–	–	–	–	524	47.039
Britisches Pfund	–	1.462	–	7.437	–	16	8.915
Chilenischer Peso	–	–	–	21.639	–	–	21.639
Chinesischer Renminbi	–	–	–	958	–	–	958
Kolumbianischer Peso	11.938	–	–	–	–	687	12.625
Tschechische Krone	–	–	–	953	–	-10	943
Ägyptisches Pfund	22.178	–	–	14.656	–	–	36.834
Euro	–	–	–	162.137	–	-79	162.058
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	-31	-31
Mexikanischer Peso	47.443	–	–	-47.218	–	1.878	2.103
Singapur-Dollar	–	–	–	39.315	–	-194	39.121
Schwedische Krone	–	–	–	3.017	–	–	3.017
US-Dollar	310.310	246.818	50.159	-209.076	123	-1.045	397.289
Gesamtbetrag	\$ 438.384	\$ 248.280	\$ 50.159	\$ -2.174	\$ 123	\$ 1.746	\$ 736.518

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]							
US-Dollar	\$ 15.693	\$ 18.739	\$ 732	\$ –	\$ –	\$ 114	\$ 35.278
Gesamtbetrag	\$ 15.693	\$ 18.739	\$ 732	\$ –	\$ –	\$ 114	\$ 35.278
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 406	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 406
Brasilianischer Real	–	–	2.001	–	–	-62	1.939
Britisches Pfund	–	–	4.863	–	–	10	4.873
Kanadischer Dollar	–	–	1.757	–	–	–	1.757
Chilenischer Peso	–	–	454	–	–	–	454
Euro	–	–	9.664	–	–	8	9.672
Indonesische Rupiah	–	–	1.997	–	–	–	1.997
Japanischer Yen	–	–	3.780	–	–	10	3.790
Mexikanischer Peso	–	–	456	–	–	5	461
Norwegische Krone	–	–	1.372	–	–	3	1.375
Schwedische Krone	–	–	1.729	–	–	3	1.732
US-Dollar	–	–	40.971	–	–	-25	40.946
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 69.450	\$ –	\$ –	\$ -48	\$ 69.402
FTGF ClearBridge US Value Fund							
Kanadischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 10.140	\$ –	\$ –	\$ 5	\$ 10.145
Euro	–	–	18.579	18.143	–	-39	36.683
Hongkong-Dollar	–	–	4.706	–	–	–	4.706
Japanischer Yen	–	–	9.102	–	–	–	9.102
Singapur-Dollar	–	–	–	1.447	–	–	1.447
US-Dollar	–	–	574.721	-19.917	–	6.018	560.822
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 617.248	\$ -327	\$ –	\$ 5.984	\$ 622.905
FTGF Putnam US Research Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 123	\$ –	\$ –	\$ 123
Britisches Pfund	–	–	16.564	-5.923	–	2	10.643
Kanadischer Dollar	–	–	8.062	-7.403	–	–	659
Dänische Krone	–	–	–	-571	–	–	-571
Euro	–	–	1.378	154.516	–	-249	155.645
Hongkong-Dollar	–	–	–	86	–	–	86
Singapur-Dollar	–	–	–	8	–	–	8
Schwedische Krone	–	–	–	-5.299	–	–	-5.299
Schweizer Franken	–	–	–	975	–	-85	890
US-Dollar	2.957	–	1.418.210	-138.217	-289	28.025	1.310.686
Gesamtbetrag	\$ 2.957	\$ –	\$ 1.444.214	\$ -1.705	\$ -289	\$ 27.693	\$ 1.472.870
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 49.841	\$ –	\$ –	\$ 49.841
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	-21	-21
Euro	–	–	–	18.129	–	633	18.762
US-Dollar	–	–	1.388.368	-67.333	–	9.937	1.330.972
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 1.388.368	\$ 637	\$ –	\$ 10.549	\$ 1.399.554
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 596	\$ –	\$ –	\$ 596
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	5	5
Chinesischer Renminbi	–	–	–	56	–	–	56
Euro	–	–	–	745	–	–	745
Singapur-Dollar	–	–	–	443	–	–	443
US-Dollar	–	–	37.646	-1.844	–	1.237	37.039
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 37.646	\$ -4	\$ –	\$ 1.242	\$ 38.884
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 50.558	\$ –	\$ 41	\$ 50.599
Euro	–	–	–	203.776	–	364	204.140
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	33	33
US-Dollar	–	–	615.331	-256.937	–	15.250	373.644
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 615.331	\$ -2.603	\$ –	\$ 15.688	\$ 628.416

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)					
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	2.670	\$	–	\$	1	\$	3.131
Britisches Pfund	–	–	–	8.619	128	–	28	–	–	8.775		
Kanadischer Dollar	–	–	–	3.520	–	–	–	–	–	3.520		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	68	–	–	–	–	68		
Dänische Krone	–	–	–	–	–	–	1	–	–	1		
Euro	–	–	–	26.152	691	–	19	–	–	26.862		
Hongkong-Dollar	–	–	–	6.870	–	–	–	–	–	6.870		
Indonesische Rupiah	–	–	–	631	–	–	–	–	–	631		
Japanischer Yen	–	–	–	9.964	–	–	–	–	–	9.964		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	1.400	–	–	–	–	1.400		
Südkoreanischer Won	–	–	–	2.103	–	–	–	–	–	2.103		
Schwedische Krone	–	–	–	2.644	32	–	–	–	–	2.676		
Schweizer Franken	–	–	–	3.115	27	–	–	–	–	3.142		
Taiwan-Dollar	–	–	–	8.165	–	–	–	–	–	8.165		
US-Dollar	–	–	–	120.367	-5.016	–	1.594	–	–	116.945		
Gesamtbetrag	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	1.643	\$	194.253
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^												
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	-714	€	–	€	689	€	24.867
Brasilianischer Real	–	–	–	35.285	-2.443	–	–	–	–	32.842		
Britisches Pfund	–	–	–	104.813	-7.735	–	20	–	–	97.098		
Kanadischer Dollar	–	–	–	112.034	42.600	–	–	–	–	154.634		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	11.176	–	-84	–	–	11.092		
Euro	–	–	–	454.823	-82.962	–	38.703	–	–	410.564		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	5.754	–	-14	–	–	5.740		
US-Dollar	–	–	–	467.130	35.124	–	19	–	–	502.273		
Gesamtbetrag	€	–	€	–	€	800	€	–	€	39.333	€	1.239.110
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	6.674	\$	–	\$	366	\$	29.168
Brasilianischer Real	–	–	–	21.713	–	–	-306	–	–	21.407		
Britisches Pfund	–	–	–	30.633	8.951	–	50	–	–	39.634		
Kanadischer Dollar	–	–	–	67.317	–	–	115	–	–	67.432		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	6.846	–	816	–	–	7.662		
Euro	–	–	–	127.391	22.428	–	363	–	–	150.182		
Mexikanischer Peso	–	–	–	5.609	–	–	–	–	–	5.609		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	56.174	–	-681	–	–	55.493		
US-Dollar	–	–	–	124.941	-101.319	–	17.882	–	–	41.504		
Gesamtbetrag	\$	–	\$	–	\$	-246	\$	–	\$	18.605	\$	418.091
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^												
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	18	\$	–	\$	2	\$	1.541
Kanadischer Dollar	–	–	–	1.521	–	–	–	–	–	264		
Euro	–	–	–	264	18	–	4	–	–	1.898		
Japanischer Yen	–	–	–	1.876	–	–	-1	–	–	289		
Singapur-Dollar	–	–	–	290	–	–	–	–	–	16		
US-Dollar	–	–	–	–	16	–	–	–	–	4.445		
Gesamtbetrag	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	545	\$	8.453
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund												
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	5.955	\$	–	\$	-89	\$	5.866
Brasilianischer Real	–	–	–	–	1.437	–	–	–	–	1.437		
Britisches Pfund	–	–	–	–	139	–	-203	–	–	-64		
Kanadischer Dollar	–	–	–	26.122	–	–	31	–	–	26.153		
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	580	–	–	–	–	580		
Euro	–	–	–	4.912	135.996	–	-1.793	–	–	139.115		
Polnischer Zloty	–	–	–	–	5.503	–	–	–	–	5.503		
Singapur-Dollar	–	–	–	–	22.546	–	44	–	–	22.590		
Schwedische Krone	–	–	–	–	500	–	-9	–	–	491		
US-Dollar	–	–	–	1.057.966	-173.803	–	1.826	–	–	885.989		
Gesamtbetrag	\$	–	\$	–	\$	-1.147	\$	–	\$	-193	\$	1.087.660
FTGF Royce US Smaller Companies Fund												
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	–	\$	–	\$	-1	\$	1.392
Euro	–	–	–	–	1.772	–	41	–	–	1.813		
Schwedische Krone	–	–	–	–	1	–	–	–	–	1		
US-Dollar	–	–	–	87.909	-1.787	–	294	–	–	86.416		
Gesamtbetrag	\$	–	\$	–	\$	-14	\$	–	\$	334	\$	89.622

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 123	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 124
Britisches Pfund	–	–	685	–	–	-10	675
Kanadischer Dollar	–	–	52	–	–	–	52
Euro	–	–	487	–	–	–	487
Indische Rupie	–	–	101	–	–	–	101
Japanischer Yen	–	–	659	–	–	–	659
Polnischer Zloty	–	–	31	–	–	–	31
Südkoreanischer Won	–	–	72	–	–	–	72
Schwedische Krone	–	–	55	–	–	1	56
Schweizer Franken	–	–	142	–	–	–	142
US-Dollar	–	–	2.819	–	–	-48	2.771
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 5.226	\$ –	\$ –	\$ -56	\$ 5.170
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ 700	\$ –	\$ –	\$ 5	\$ 705
Britisches Pfund	–	–	352	–	–	–	352
Chinesischer Renminbi	–	–	1.089	–	–	1	1.090
Hongkong-Dollar	–	–	2.456	–	–	–	2.456
Indische Rupie	–	–	2.900	–	–	-161	2.739
Indonesische Rupiah	–	–	152	–	–	–	152
Mexikanischer Peso	–	–	367	–	–	–	367
Polnischer Zloty	–	–	329	–	–	5	334
Saudi-Rial	–	–	566	–	–	4	570
Südafrikanischer Rand	–	–	845	–	–	–	845
Südkoreanischer Won	–	–	4.371	–	–	10	4.381
Taiwan-Dollar	–	–	4.508	–	–	-1	4.507
US-Dollar	–	–	1.938	–	–	-155	1.783
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 20.573	\$ –	\$ –	\$ -292	\$ 20.281
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]							
Euro	€ 52.577	€ 17.913	€ –	€ –	€ –	€ 361	€ 70.851
Gesamtbetrag	€ 52.577	€ 17.913	€ –	€ –	€ –	€ 361	€ 70.851
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]							
Euro	€ 22.163	€ 12.931	€ –	€ –	€ –	€ 2.126	€ 37.220
Gesamtbetrag	€ 22.163	€ 12.931	€ –	€ –	€ –	€ 2.126	€ 37.220
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]							
Euro	€ 3.486	€ 1.421	€ –	€ –	€ –	€ 96	€ 5.003
Gesamtbetrag	€ 3.486	€ 1.421	€ –	€ –	€ –	€ 96	€ 5.003
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 12	\$ –	\$ –	\$ 12
Euro	–	–	–	4	–	–	4
Singapur-Dollar	–	–	–	1.255	–	-78	1.177
US-Dollar	722.595	830.626	24	-1.271	–	-10.611	1.541.363
Gesamtbetrag	\$ 722.595	\$ 830.626	\$ 24	\$ –	\$ –	\$ -10.689	\$ 1.542.556
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 1.286	\$ –	\$ –	\$ 16.557	\$ –	\$ 29	\$ 17.872
Euro	7.373	1.446	–	-2.880	–	125	6.064
US-Dollar	20.373	456	1.336	-14.033	–	67	8.199
Gesamtbetrag	\$ 29.032	\$ 1.902	\$ 1.336	\$ -356	\$ –	\$ 221	\$ 32.135
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 1.930	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.930
Euro	–	–	–	38.940	–	97	39.037
Schweizer Franken	–	–	1.019	–	–	3	1.022
US-Dollar	–	–	71.008	-39.279	–	-272	31.457
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 73.957	\$ -339	\$ –	\$ -172	\$ 73.446
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -12.571	\$ –	\$ 168	\$ -12.403
Dänische Krone	–	–	–	-3.993	–	–	-3.993
Euro	–	–	12.229	52.877	–	-225	64.881
Schweizer Franken	–	–	–	595	–	–	595
US-Dollar	1.353	–	521.627	-37.290	-61	-17.679	467.950
Gesamtbetrag	\$ 1.353	\$ –	\$ 533.856	\$ -382	\$ -61	\$ -17.736	\$ 517.030

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Putnam Balanced Fund^							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 1.564	\$ -1.453	\$ –	\$ –	\$ 111
Kanadischer Dollar	–	–	749	-1.070	–	–	-321
Dänische Krone	–	–	–	-55	–	–	-55
Euro	–	–	776	-788	–	–	-12
Hongkong-Dollar	–	–	–	1	–	–	1
Schwedische Krone	–	–	–	-310	–	–	-310
US-Dollar	75.136	4.042	131.792	3.659	-8	6.409	221.030
Gesamtbetrag	\$ 75.136	\$ 4.042	\$ 134.881	\$ -16	\$ -8	\$ 6.409	\$ 220.444
FTGF Putnam Global Healthcare Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 234	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 235
Dänische Krone	–	–	57	–	–	–	57
Euro	–	–	175	–	–	–	175
Japanischer Yen	–	–	101	–	–	1	102
Singapur-Dollar	–	–	–	2	–	–	2
Schweizer Franken	–	–	329	–	–	–	329
US-Dollar	–	–	3.054	-2	–	-23	3.029
Gesamtbetrag	\$ –	\$ –	\$ 3.950	\$ –	\$ –	\$ -21	\$ 3.929

Zum 28. Februar 2025

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund							
US-Dollar	\$ 1.018.211	\$ 687.039	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -24.494	\$ 1.680.756
Gesamt	\$ 1.018.211	\$ 687.039	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -24.494	\$ 1.680.756
FTGF Western Asset US Core Bond Fund							
US-Dollar	\$ 67.113	\$ 27.824	\$ 4.044	\$ –	\$ 393	\$ -1.472	\$ 97.902
Gesamt	\$ 67.113	\$ 27.824	\$ 4.044	\$ –	\$ 393	\$ -1.472	\$ 97.902
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.153	\$ –	\$ 77	\$ 2230
Brasilianischer Real	2.662	–	–	-2.731	–	87	18
Britisches Pfund	–	–	–	-1.501	5	263	-1.233
Kanadischer Dollar	–	–	–	426	–	122	548
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.656	–	158	-2.498
Euro	–	–	–	-1.094	–	284	-810
Indische Rupie	1.652	–	–	-1.682	–	48	18
Japanischer Yen	–	–	–	304	86	194	584
Malaysischer Ringgit	–	–	–	–	–	25	25
Mexikanischer Peso	–	–	–	-88	–	247	159
Schweizer Franken	–	–	–	-1	–	–	-1
US-Dollar	174.156	59.976	–	6.806	671	8.124	249.733
Gesamt	\$ 178.470	\$ 59.976	\$ –	\$ -64	\$ 762	\$ 9.629	\$ 248.773
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 45.552	\$ –	\$ –	\$ 45.552
Brasilianischer Real	1.684	–	–	–	–	25	1.709
Britisches Pfund	9.979	11.236	–	-21.603	38	1.780	1.430
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	2	2
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-2.392	–	–	-2.392
Kolumbianischer Peso	–	–	–	–	–	74	74
Tschechische Krone	–	–	–	–	–	35	35
Euro	20.689	7.158	–	-24.923	-208	682	3.398
Indische Rupie	2.076	–	–	-2.338	–	69	-193
Indonesische Rupiah	2.391	–	–	–	–	44	2.435
Japanischer Yen	–	–	–	4.046	–	–	4.046
Mexikanischer Peso	4.657	–	–	-3.092	–	398	1.963
Polnischer Zloty	3.983	–	–	672	–	78	4.733
Singapur-Dollar	–	–	–	717	–	–	717
Südafrikanischer Rand	2.957	–	–	23.762	–	-1.470	25.249
Schweizer Franken	–	–	–	59.528	–	-1	59.527
Taiwan-Dollar	–	–	–	-3.025	–	–	-3.025
US-Dollar	115.198	34.852	3.211	-77.361	-300	20.463	96.063
Gesamt	\$ 163.614	\$ 53.246	\$ 3.211	\$ -457	\$ -470	\$ 22.179	\$ 241.323

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset US High Yield Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 13	\$ –	\$ –	\$ 13
Euro	–	–	–	1.347	–	–	1.347
Hongkong-Dollar	–	–	–	–	–	-1	-1
Singapur-Dollar	–	–	–	2.909	–	-173	2.736
US-Dollar	70.788	16.390	957	-4.264	60	-1.073	82.858
Gesamt	\$ 70.788	\$ 16.390	\$ 957	\$ 5	\$ 60	\$ -1.247	\$ 86.953
FTGF Western Asset Global High Yield Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.433	\$ –	\$ 2	\$ 3.435
Britisches Pfund	506	553	–	-39	–	220	1.240
Euro	2.254	105	–	2.291	–	62	4.712
Hongkong-Dollar	–	–	2	–	–	-1	1
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	43	43
Russischer Rubel	–	–	–	–	–	70	70
Singapur-Dollar	–	–	–	1.369	–	–	1.369
US-Dollar	30.120	6.899	186	-7.080	92	-298	29.919
Gesamt	\$ 32.880	\$ 7.557	\$ 188	\$ -26	\$ 92	\$ 98	\$ 40.789
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 8.285	\$ –	\$ 17	\$ 8.302
Chinesischer Renminbi	37.739	–	–	28.712	–	934	67.385
Euro	–	–	–	3.487	–	–	3.487
Indische Rupie	23.779	–	–	–	–	358	24.137
Indonesische Rupiah	13.847	–	–	–	–	86	13.933
Malaysischer Ringgit	28.627	–	–	–	–	319	28.946
Philippinischer Peso	12.881	–	–	–	–	86	12.967
Singapur-Dollar	9.445	7.592	–	6.992	–	251	24.280
Südkoreanischer Won	26.776	–	–	-2.973	21	811	24.635
Schweizer Franken	–	–	–	15	–	–	15
Thailändischer Baht	18.332	–	–	–	–	95	18.427
US-Dollar	6.241	–	5.439	-44.605	–	-630	-33.555
Gesamt	\$ 177.667	\$ 7.592	\$ 5.439	\$ -87	\$ 21	\$ 2.327	\$ 192.959
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund							
Britisches Pfund	\$ 19.424	\$ 4.903	\$ –	\$ 45.555	\$ –	\$ 1.293	\$ 71.175
Euro	76.048	8.432	–	-75.791	140	1.945	10.774
Japanischer Yen	–	–	–	-243	–	192	-51
Schwedische Krone	–	–	–	5.735	–	56	5.791
Schweizer Franken	–	–	–	4.405	–	165	4.570
US-Dollar	48.778	11.933	4.433	21.541	-182	-99	86.404
Gesamt	\$ 144.250	\$ 25.268	\$ 4.433	\$ 1.202	\$ -42	\$ 3.552	\$ 178.663
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ 2.810	\$ –	\$ –	\$ -2.073	\$ -10	\$ 277	\$ 1.004
Brasilianischer Real	1.836	–	–	-44	–	33	1.825
Britisches Pfund	6.884	136	–	-8.330	9	359	-942
Kanadischer Dollar	1.674	–	–	69.016	–	191	70.881
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-11.569	–	-1	-11.570
Euro	14.561	5.299	–	-24.074	-74	626	-3.662
Indonesische Rupiah	1.204	–	–	–	–	105	1.309
Japanischer Yen	10.196	–	–	-9.605	67	139	797
Mexikanischer Peso	1.896	–	–	-953	–	44	987
Norwegische Krone	1.628	–	–	-572	–	35	1.091
Polnischer Zloty	1.626	–	–	-1.622	–	31	35
Südafrikanischer Rand	1.761	–	–	-662	–	89	1.188
Südkoreanischer Won	1.716	–	–	-1.748	–	55	23
US-Dollar	29.924	4.980	8.932	-8.442	179	-1.208	34.365
Gesamt	\$ 77.716	\$ 10.415	\$ 8.932	\$ -678	\$ 171	\$ 775	\$ 97.331
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 791	\$ 1.062	\$ –	\$ -1.967	\$ –	\$ 118	\$ 4
Kanadischer Dollar	–	–	–	-5	–	–	-5
Euro	9.496	3.933	–	-8.354	-81	28	5.022
Japanischer Yen	–	–	–	-26	–	31	5
US-Dollar	8626	1.688	1.392	10.372	55	-33	22.100
Gesamt	\$ 18.913	\$ 6.683	\$ 1.392	\$ 20	\$ -26	\$ 144	\$ 27.126

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 2.239	\$ -14	\$ 130	\$ 2.355
Brasilianischer Real	1.683	–	–	-1.141	-774	90	-142
Britisches Pfund	2.063	1.844	–	277.530	75	215	281.727
Kanadischer Dollar	–	–	–	16.931	–	853	17.784
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-4.303	–	255	-4.048
Euro	–	1.877	–	50.283	-322	757	52.595
Indische Rupie	3.139	–	–	-3.187	–	92	44
Jamaika-Dollar	198	–	–	–	–	6	204
Japanischer Yen	–	–	–	25.967	–	–	25.967
Mexikanischer Peso	1.039	–	–	-1.557	89	729	300
Neuseeland-Dollar	–	–	–	–	–	8	8
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	2	2
Schweizer Franken	–	–	–	4.140	–	–	4.140
Türkische Lira	–	–	–	–	–	2	2
US-Dollar	227.044	137.680	–	-362.564	984	22.941	26.085
Gesamt	\$ 235.166	\$ 141.401	\$ –	\$ 4.338	\$ 38	\$ 26.080	\$ 407.023
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1.339	\$ –	\$ –	\$ 1.339
Schweizer Franken	–	–	–	73	–	–	73
US-Dollar	99.709	397.095	15.274	-1.405	-1.088	4.205	513.790
Gesamt	\$ 99.709	\$ 397.095	\$ 15.274	\$ 7	\$ -1.088	\$ 4.205	\$ 515.202
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]							
US-Dollar	\$ 1.136.665	\$ 87.935	\$ 77.894	\$ –	\$ 1.668	\$ -83.775	\$ 1.220.387
Gesamt	\$ 1.136.665	\$ 87.935	\$ 77.894	\$ –	\$ 1.668	\$ -83.775	\$ 1.220.387
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 32	\$ –	\$ 12	\$ 44
Brasilianischer Real	94	–	–	601	-69	5	631
Britisches Pfund	–	–	–	-376	4	52	-320
Kanadischer Dollar	–	–	–	132	–	11	143
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-829	–	–	-829
Euro	–	–	–	-220	–	18	-202
Indische Rupie	233	–	–	–	–	6	239
Japanischer Yen	–	–	–	316	–	6	322
Mexikanischer Peso	–	–	–	538	–	94	632
Norwegische Krone	–	–	–	154	–	–	154
Schweizer Franken	–	–	–	-348	–	–	-348
US-Dollar	13.727	1.669	1.645	-3	42	771	17.851
Gesamt	\$ 14.054	\$ 1.669	\$ 1.645	\$ -3	\$ -23	\$ 975	\$ 18.317
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 1.586	\$ –	\$ –	\$ -409	\$ –	\$ 17	\$ 1.194
Britisches Pfund	14.309	–	–	-3.071	–	82	11.320
Kanadischer Dollar	–	–	–	1.400	–	–	1.400
Chilenischer Peso	–	–	–	458	–	–	458
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.551	–	–	-1.551
Kolumbianischer Peso	114	–	–	-115	–	9	8
Euro	–	–	–	14.435	–	71	14.506
Japanischer Yen	–	–	–	399	–	–	399
Mexikanischer Peso	3.496	–	–	-796	–	127	2.827
Neuseeland-Dollar	–	–	–	1.194	–	–	1.194
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	332	332
US-Dollar	5.299	34.391	1.367	-11.583	–	-407	29.067
Gesamt	\$ 24.804	\$ 34.391	\$ 1.367	\$ 361	\$ –	\$ 231	\$ 61.154

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]							
Brasilianischer Real	\$ 11.483	\$ –	\$ –	\$ -11.735	\$ –	\$ 210	\$ -42
Britisches Pfund	–	–	–	2.777	104	-1	2.880
Kanadischer Dollar	–	–	–	6.674	-234	-289	6.151
Chilenischer Peso	–	–	–	6.670	–	–	6.670
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-17.422	–	–	-17.422
Kolumbianischer Peso	5.244	–	–	-5.380	–	209	73
Ägyptisches Pfund	9.215	–	–	–	–	–	9.215
Euro	–	–	–	29.206	–	–	29.206
Ungarischer Forint	–	–	–	-6.672	–	–	-6.672
Mexikanischer Peso	9.506	–	–	3.739	–	459	13.704
Neuseeland-Dollar	–	–	–	13.213	–	–	13.213
Polnischer Zloty	–	4.089	–	-4.067	–	137	159
Südafrikanischer Rand	5.659	–	–	-2.603	–	4	3.060
Schweizer Franken	–	–	–	-6.675	–	–	-6.675
US-Dollar	53.704	28.018	4.102	-8.202	–	2.890	80.512
Gesamt	\$ 94.811	\$ 32.107	\$ 4.102	\$ -477	\$ -130	\$ 3.619	\$ 134.032
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]							
Britisches Pfund	\$ 321	\$ –	\$ –	\$ 37	\$ –	\$ 4	\$ 362
Kanadischer Dollar	–	–	–	17.902	–	-1	17.901
Euro	2.257	–	–	8.972	–	49	11.278
Schwedische Krone	–	–	–	-3	–	–	-3
Schweizer Franken	–	–	–	-3	–	–	-3
US-Dollar	36.559	239	3.041	-27.136	23	826	13.552
Gesamt	\$ 39.137	\$ 239	\$ 3.041	\$ -231	\$ 23	\$ 878	\$ 43.087
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund							
Australischer Dollar	\$ 8.660	\$ –	\$ –	\$ 2.575	\$ –	\$ 121	\$ 11.356
Brasilianischer Real	6.950	–	–	-6.901	–	129	178
Britisches Pfund	30.255	–	–	-24.257	–	97	6.095
Kanadischer Dollar	5.226	–	–	-237	–	-1	4.988
Chilenischer Peso	–	–	–	5.496	–	–	5.496
Chinesischer Renminbi	–	–	–	-1.373	–	–	-1.373
Kolumbianischer Peso	967	–	–	-908	–	70	129
Dänische Krone	–	–	–	-27	–	–	-27
Ägyptisches Pfund	8.372	–	–	–	–	–	8.372
Euro	8.845	–	–	42.619	–	–	51.464
Israelischer Schekel	–	–	–	-44	–	–	-44
Japanischer Yen	–	–	–	21.266	–	–	21.266
Mexikanischer Peso	18.100	–	–	2.540	–	668	21.308
Neuseeland-Dollar	–	–	–	18.345	–	1	18.346
Norwegische Krone	–	–	–	-19	–	–	-19
Polnischer Zloty	–	–	–	-68	–	600	532
Singapur-Dollar	–	–	–	-46	–	1	-45
Südafrikanischer Rand	7.532	–	–	-3.522	–	5	4.015
Schwedische Krone	–	–	–	-20	–	–	-20
US-Dollar	35.980	42.783	5.563	-56.121	–	-717	27.488
Gesamt	\$ 130.887	\$ 42.783	\$ 5.563	\$ -702	\$ –	\$ 974	\$ 179.505
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.507	\$ –	\$ –	\$ 3.507
Brasilianischer Real	17.633	–	–	-16.237	–	263	1.659
Britisches Pfund	19.030	1.327	–	-1.739	–	338	18.956
Chinesischer Renminbi	–	–	–	1.643	–	–	1.643
Kolumbianischer Peso	2.517	–	–	–	–	171	2.688
Tschechische Krone	–	–	–	470	–	-1	469
Ägyptisches Pfund	24.511	–	–	–	–	–	24.511
Euro	–	–	–	337.321	–	520	337.841
Mexikanischer Peso	54.493	–	–	–	–	1.821	56.314
Singapur-Dollar	–	–	–	44.381	–	49	44.430
Schwedische Krone	–	–	–	2.334	–	–	2.334
US-Dollar	503.865	237.133	30.962	-371.361	474	19.659	420.732
Gesamt	\$ 622.049	\$ 238.460	\$ 30.962	\$ 319	\$ 474	\$ 22.820	\$ 915.084
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]							
Ägyptisches Pfund	\$ 314	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 1	\$ 315
US-Dollar	7.799	2.464	483	–	-80	-84	10.582
Gesamt	\$ 8.113	\$ 2.464	\$ 483	\$ –	\$ -80	\$ -83	\$ 10.897

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]							
US-Dollar	\$ 29.933	\$ 5.932	\$ 742	\$ –	\$ 22	\$ 188	\$ 36.817
Gesamt	\$ 29.933	\$ 5.932	\$ 742	\$ –	\$ 22	\$ 188	\$ 36.817
FTGF ClearBridge US Value Fund							
Kanadischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ 17.094	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 17.094
Euro	–	–	32.190	58.586	–	223	90.999
Japanischer Yen	–	–	9.577	–	–	–	9.577
Singapur-Dollar	–	–	–	1.576	–	15	1.591
US-Dollar	–	–	1.081.568	-59.362	–	73.902	1.096.108
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.140.429	\$ 800	\$ –	\$ 74.140	\$ 1.215.369
FTGF ClearBridge US Appreciation Fund							
Euro	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ -3	\$ -3
US-Dollar	–	–	179.506	–	–	2.257	181.763
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 179.506	\$ –	\$ –	\$ 2.254	\$ 181.760
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund							
Brasilianischer Real	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 42.969	\$ –	\$ –	\$ 42.969
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	58	58
Euro	–	–	–	100.049	–	-75	99.974
US-Dollar	–	–	1.948.068	-142.394	–	51.306	1.856.980
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 1.948.068	\$ 624	\$ –	\$ 51.289	\$ 1.999.981
FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 3.160	\$ –	\$ -19	\$ 3.141
Britisches Pfund	–	–	–	176	–	20	196
Chinesischer Renminbi	–	–	–	643	–	–	643
Euro	–	–	–	636	–	-2	634
Singapur-Dollar	–	–	–	1.211	–	–	1.211
Schwedische Krone	–	–	–	25	–	1	26
Schweizer Franken	–	–	–	63	–	–	63
US-Dollar	–	–	175.395	-5.939	–	1.359	170.815
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 175.395	\$ -25	\$ –	\$ 1.359	\$ 176.729
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund							
Australischer Dollar	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 723	\$ –	\$ –	\$ 723
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	5	5
Chinesischer Renminbi	–	–	–	53	–	–	53
Euro	–	–	–	617	–	1	618
Singapur-Dollar	–	–	–	321	–	3	324
US-Dollar	–	–	38.854	-1.720	–	1.579	38.713
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 38.854	\$ -6	\$ –	\$ 1.588	\$ 40.436
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 49.493	\$ –	\$ 458	\$ 49.951
Euro	–	–	–	22.654	–	162	22.816
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	15	15
US-Dollar	–	–	912.104	-71.224	–	7.694	848.574
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 912.104	\$ 923	\$ –	\$ 8.329	\$ 921.356
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund							
Britisches Pfund	\$ –	\$ –	\$ 1.365	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 1.368
Kanadischer Dollar	–	–	732	–	–	–	732
Dänische Krone	–	–	479	–	–	–	479
Euro	–	–	2.906	–	–	5	2.911
Hongkong-Dollar	–	–	690	–	–	–	690
Japanischer Yen	–	–	1060	–	–	1	1.061
Südkoreanischer Won	–	–	247	–	–	1	248
Schweizer Franken	–	–	190	–	–	–	190
Taiwan-Dollar	–	–	513	–	–	–	513
US-Dollar	–	–	19.019	–	–	118	19.137
Gesamt	\$ –	\$ –	\$ 27.201	\$ –	\$ –	\$ 128	\$ 27.329

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Anlagen in festverzinsli- chen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in variabel verzins- lichen Wertpapieren (in Tsd.)	Anlagen in unverzinslichen Wertpapieren (in Tsd.)	Devisentermin- kontrakte (in Tsd.)	Sonstige Derivate (in Tsd.)	Sonstige Nettover- mögenswerte/ -verbindlichkeiten (in Tsd.)	Gesamt- Nettoinventar- wert (in Tsd.)
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]							
Australischer Dollar	€	–	€	–	€	476	€ 15.500
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	–	12.925
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	–	52.327
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	–	142.061
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	244	11.175
Euro	–	–	–	–	–	15.490	123.301
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	-29	4.455
US-Dollar	–	–	–	–	–	866	372.427
Gesamt	€	–	€	–	€	17.043	€ 734.171
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund							
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	217	\$ 16.401
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	–	10.802
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	140	36.896
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	110	47.367
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	–	1.153
Euro	–	–	–	–	–	932	84.461
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	95	41.556
US-Dollar	–	–	–	–	–	3.914	48.513
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	5.408	\$ 287.149
FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^]							
Britisches Pfund	\$	–	\$	–	\$	-1	\$ 1.021
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	–	130
Euro	–	–	–	–	–	3	1.414
Indonesische Rupiah	–	–	–	–	–	–	58
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	–	225
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	–	13
US-Dollar	–	–	–	–	–	580	3.838
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	582	\$ 6.699
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund							
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1.269	\$ 6.055
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	-1	1.261
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	361	488
Kanadischer Dollar	–	–	–	–	–	36	22.986
Chinesischer Renminbi	–	–	–	–	–	48	1.926
Euro	–	–	–	–	–	-211	67.424
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	5.757
Singapur-Dollar	–	–	–	–	–	38	21.658
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	105
US-Dollar	–	–	–	–	–	-2.554	856.674
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	-1.014	\$ 984.334
FTGF Royce US Smaller Companies Fund							
Kanadischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	1	\$ 1.883
Euro	–	–	–	–	–	-2	323
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	–	1
US-Dollar	–	–	–	–	–	-464	80.646
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	-465	\$ 82.853
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]							
Australischer Dollar	\$	–	\$	–	\$	3	\$ 212
Brasilianischer Real	–	–	–	–	–	1	47
Britisches Pfund	–	–	–	–	–	–	653
Euro	–	–	–	–	–	1	473
Japanischer Yen	–	–	–	–	–	–	487
Polnischer Zloty	–	–	–	–	–	–	59
Südkoreanischer Won	–	–	–	–	–	–	84
Schwedische Krone	–	–	–	–	–	1	87
Schweizer Franken	–	–	–	–	–	–	89
US-Dollar	–	–	–	–	–	-84	2.131
Gesamt	\$	–	\$	–	\$	-78	\$ 4.322

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

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

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

Die nachfolgende Tabelle enthält eine Sensitivitätsanalyse in Bezug auf das Fremdwährungsrisiko und dessen Auswirkung auf den Nettoinventarwert der Fonds, sofern das Fremdwährungsrisiko als erheblich eingestuft wird. Am 28. Februar 2026 und am 28. Februar 2025 wurde für alle Fonds ein Auszug der zugrunde liegenden Positionen erstellt. Die Wechselkurse wurden um +/- 5 % erhöht/ gesenkt (aufgrund der Beschaffenheit der Märkte, in denen die Fonds anlegen, wurde eine 5 %-ige Erhöhung/Senkung vorgenommen); es wurde eine Schätzung der entsprechenden Auswirkung auf den Gesamtnettoinventarwert vorgenommen. Des Weiteren wird angenommen, dass auch alle anderen Marktparameter unverändert bleiben.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(b) Fremdwährungsrisiko – (Fortsetzung)

Fonds	Währung	Auswirkung auf den Nettoinventarwert aufgrund von Änderungen der Wechselkurse* (Betrag in der Basiswährung des Fonds) (in Tsd.)			
		28. Februar 2026		28. Februar 2025	
		Positiv 5 %	Negativ 5 %	Positiv 5 %	Negativ 5 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Australischer Dollar	/	/	2.397	-2.169
	Euro	1.001	-906	/	/
	Südafrikanischer Rand	1.044	-945	1.329	-1.202
	Schweizer Franken	3.755	-3.398	3.133	-2.835
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Euro	285	-258	248	-224
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Chinesischer Renminbi	/	/	3.547	-3.209
	Indische Rupie	916	-829	1.270	-1.149
	Malaysischer Ringgit	882	-798	1.523	-1.378
	Singapur-Dollar	950	-859	1.278	-1.156
	Südkoreanischer Won	823	-745	1.297	-1.173
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Britisches Pfund	3.203	-2.898	3.746	-3.389
FTGF Western Asset Global Bond Fund^	Kanadischer Dollar	4.098	-3.708	3.731	-3.375
	Chinesischer Renminbi	/	/	-609	551
FTGF Western Asset Global Credit Fund^	Euro	/	/	264	-239
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^	Britisches Pfund	13.500	-12.215	14.828	-13.416
	Euro	/	/	2.768	-2.505
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Britisches Pfund	480	-434	596	-539
	Euro	610	-552	763	-691
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	Australischer Dollar	341	-309	/	/
	Brasilianischer Real	271	-245	/	/
	Chinesischer Renminbi	/	/	-917	830
	Ägyptisches Pfund	297	-269	/	/
	Euro	-482	436	1.537	-1.391
	Mexikanischer Peso	/	/	721	-653
	Südkoreanischer Won	500	-453	/	/
	Schweizer Franken	-503	455	/	/
FTGF Brandywine Global High Yield Fund^	Kanadischer Dollar	1.014	-918	942	-852
	Euro	904	-818	594	-537
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^	Australischer Dollar	1.195	-1.081	/	/
	Euro	/	/	2.709	-2.451
	Japanischer Yen	1.858	-1.681	1.119	-1.013
	Mexikanischer Peso	/	/	1.121	-1.015
	Neuseeland-Dollar	1.117	-1.011	966	-874
	Südkoreanischer Won	1.454	-1.316	/	/
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Euro	8.529	-7.717	17.781	-16.088
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund^	Euro	509	-461	/	/
FTGF Putnam US Research Fund	Euro	8.192	-7.412	/	/
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Euro	10.744	-9.721	/	/
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	Euro	1.414	-1.279	153	-139
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^	Kanadischer Dollar	8.139	-7.364	7.477	-6.765
	US-Dollar	26.435	-23.918	19.601	-17.735
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Britisches Pfund	/	/	1.942	-1.757
	Kanadischer Dollar	3.549	-3.211	2.493	-2.256
	Euro	7.904	-7.152	4.445	-4.022
	Singapur-Dollar	2.921	-2.643	2.187	-1.979
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^	Britisches Pfund	81	-73	54	-49
	Euro	100	-90	74	-67
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Euro	7.322	-6.625	/	/
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^	Britisches Pfund	36	-32	34	-31
	Euro	/	/	25	-23
	Japanischer Yen	35	-31	26	-23
FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund^	Euro	/	/	676	-612
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund^	Hongkong-Dollar	129	-117	390	-353
	Indische Rupie	144	-130	323	-292
	Südkoreanischer Won	231	-209	184	-167
	Taiwan-Dollar	237	-215	301	-273
FTGF Franklin European Unconstrained Fund^	Schwedische Krone	/	/	505	-457
FTGF Martin Currie Improving Society Fund^	Britisches Pfund	/	/	180	-163
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^	Britisches Pfund	941	-851	/	/
	Euro	319	-289	/	/
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^	Euro	2.055	-1.859	/	/
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund^	Euro	3.415	-3.090	/	/

Eine Analyse wird angegeben, sofern der Fonds ein erhebliches Fremdwährungsentagement enthält. Als erheblich gilt ein Engagement, wenn es 10 % des Nettovermögens übersteigt. Veränderungen sämtlicher Wechselkurse werden sich direkt auf den Nettoinventarwert auswirken. Die Wechselkurse zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 sind in Erläuterung 11 angegeben. Diese Sensitivitätsanalyse sollte nicht als Prognose für die künftige Wertentwicklung verwendet werden.

Die Sensitivitätsanalyse für das Fremdwährungsrisiko für den FTGF Western Asset 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^ (für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025, da dieser Fonds den Handel während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2026 einstellte) und FTGF Putnam Global Healthcare Fund wurde in die Berechnung des Marktrisikos unter Anwendung des VaR-Ansatzes einbezogen (Erläuterung 12.1 oben).

(c) Zinsrisiko

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

Zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 wurden die gesamten Barmittel der Fonds bei der Verwahrstelle oder sonstigen Brokern geführt und haben das Potenzial zur Erwirtschaftung von Zinsen, deren Höhe je nach den aktuellen Marktzinsen schwankt.

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Die gewichtete durchschnittliche Rendite und die gewichteten durchschnittlichen Laufzeiten bis zur Fälligkeit der festverzinslichen Instrumente jedes Fonds nach Währung stellten sich zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 wie folgt dar:

Zum 28. Februar 2026

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,00 %	0,13
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	4,24 %	17,12
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	10,52 %	2,03
Chilenischer Peso	5,70 %	7,09
Tschechische Krone	2,31 %	7,63
Indische Rupie	7,23 %	4,61
Malaysischer Ringgit	4,02 %	9,26
Peruanischer Sol	5,41 %	8,46
Britisches Pfund	0,00 %	23,85
Südafrikanischer Rand	8,66 %	17,93
Uruguayischer Peso	7,79 %	5,23
US-Dollar	4,45 %	17,39
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,25 %	0,84
Euro	3,83 %	6,27
Indische Rupie	6,56 %	2,53
Japanischer Yen	3,36 %	29,83
Mexikanischer Peso	8,58 %	11,44
Polnischer Zloty	2,04 %	6,16
Britisches Pfund	5,12 %	6,19
Südafrikanischer Rand	7,77 %	9,75
US-Dollar	5,12 %	9,10
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,47 %	5,84
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	4,53 %	4,22
Britisches Pfund	5,03 %	3,74
US-Dollar	7,24 %	6,88
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	6,92 %	12,13
Hongkong-Dollar	3,71 %	29,30
Indische Rupie	6,85 %	11,50
Indonesische Rupiah	6,66 %	12,56
Malaysischer Ringgit	4,21 %	9,02
Philippinischer Peso	6,20 %	9,88
Singapur-Dollar	2,45 %	15,90
Südkoreanischer Won	2,31 %	11,49
Thailändischer Baht	2,89 %	12,31
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	2,54 %	4,84
Britisches Pfund	3,71 %	3,67
US-Dollar	3,43 %	4,38
FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,17 %	4,84
Kanadischer Dollar	3,14 %	11,06
Chinesischer Renminbi	2,09 %	9,42
Euro	2,42 %	9,12
Indonesische Rupiah	7,28 %	13,13
Japanischer Yen	0,80 %	7,95
Mexikanischer Peso	8,78 %	16,72
Norwegische Krone	3,25 %	7,49
Polnischer Zloty	2,04 %	6,16
Britisches Pfund	4,17 %	9,49
Südafrikanischer Rand	7,77 %	7,27
Südkoreanischer Won	2,42 %	5,48
US-Dollar	4,21 %	14,75
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	3,48 %	7,33
Japanischer Yen	3,36 %	29,83
Britisches Pfund	5,90 %	4,73
US-Dollar	5,01 %	11,61
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,17 %	4,84
Euro	5,54 %	7,21
Indische Rupie	7,23 %	4,61
Jamaika-Dollar	9,08 %	4,68
Mexikanischer Peso	6,33 %	2,12
Britisches Pfund	5,64 %	4,38
US-Dollar	6,94 %	8,76

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2026 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	6,31 %	25,49
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	4,96 %	23,58
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	11,64 %	6,85
Tschechische Krone	2,31 %	7,63
Indische Rupie	7,23 %	4,61
Malaysischer Ringgit	4,02 %	9,26
Mexikanischer Peso	8,78 %	16,72
Peruanischer Sol	5,41 %	8,46
Südafrikanischer Rand	8,66 %	17,93
US-Dollar	4,29 %	14,39
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	4,70 %	10,49
Kanadischer Dollar	0,00 %	0,45
Kolumbianischer Peso	13,69 %	20,42
Ungarischer Forint	6,71 %	9,66
Indische Rupie	7,02 %	9,99
Japanischer Yen	3,35 %	34,29
Mexikanischer Peso	9,02 %	25,84
Norwegische Krone	1,79 %	0,97
Britisches Pfund	4,54 %	18,81
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Australischer Dollar	4,41 %	10,65
Brasilianischer Real	11,81 %	7,88
Kolumbianischer Peso	13,61 %	19,37
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,39
Ungarischer Forint	6,71 %	9,66
Mexikanischer Peso	9,03 %	27,11
US-Dollar	5,30 %	14,68
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	6,77 %	4,97
Britisches Pfund	5,20 %	3,73
US-Dollar	6,80 %	4,31
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]		
Australischer Dollar	4,70 %	10,49
Brasilianischer Real	11,89 %	8,40
Kolumbianischer Peso	13,61 %	19,38
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,44
Ungarischer Forint	6,71 %	9,66
Indische Rupie	7,03 %	9,99
Japanischer Yen	3,35 %	34,28
Mexikanischer Peso	9,02 %	26,13
Britisches Pfund	4,53 %	18,71
US-Dollar	5,81 %	28,45
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Brasilianischer Real	11,74 %	7,48
Kolumbianischer Peso	13,68 %	17,59
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,15
Mexikanischer Peso	8,85 %	23,90
US-Dollar	6,21 %	5,20
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
US-Dollar	4,71 %	18,33
FTGF Putnam US Research Fund		
US-Dollar	0,00 %	0,31
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,45 %	2,18
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]		
Euro	3,30 %	3,13
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]		
Euro	4,46 %	4,75
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]		
US-Dollar	2,68 %	1,74
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]		
Euro	4,97 %	4,85
Britisches Pfund	6,57 %	4,52
US-Dollar	6,73 %	5,66
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^]		
US-Dollar	0,00 %	0,35
FTGF Putnam Balanced Fund[^]		
US-Dollar	4,31 %	12,71

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		
US-Dollar	2,21 %	0,14
FTGF Western Asset US Core Bond Fund		
US-Dollar	4,39 %	20,43
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		
Brasilianischer Real	6,76 %	1,93
Indische Rupie	7,22 %	5,61
US-Dollar	4,61 %	18,33
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Brasilianischer Real	10,79 %	1,84
Euro	4,41 %	5,60
Indische Rupie	6,62 %	3,53
Indonesische Rupiah	6,93 %	2,21
Mexikanischer Peso	9,22 %	13,23
Polnischer Zloty	2,25 %	7,16
Britisches Pfund	5,31 %	5,53
Südafrikanischer Rand	9,92 %	16,01
US-Dollar	4,84 %	8,78
FTGF Western Asset US High Yield Fund		
US-Dollar	7,53 %	5,51
FTGF Western Asset Global High Yield Fund		
Euro	5,23 %	4,09
Britisches Pfund	5,51 %	2,75
US-Dollar	6,91 %	6,49
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund		
Chinesischer Renminbi	6,77 %	16,75
Indische Rupie	7,10 %	10,76
Indonesische Rupiah	7,01 %	23,90
Malaysischer Ringgit	3,99 %	6,50
Philippinischer Peso	6,33 %	10,88
Singapur-Dollar	2,77 %	27,23
Südkoreanischer Won	2,22 %	11,33
Thailändischer Baht	2,71 %	10,44
US-Dollar	4,53 %	4,99
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Euro	2,11 %	4,24
Britisches Pfund	3,15 %	3,33
US-Dollar	3,32 %	4,40
FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^]		
Australischer Dollar	3,90 %	9,23
Brasilianischer Real	12,33 %	5,84
Kanadischer Dollar	3,48 %	16,80
Euro	1,49 %	9,37
Indonesische Rupiah	7,49 %	14,13
Japanischer Yen	0,75 %	8,28
Mexikanischer Peso	9,47 %	17,72
Norwegische Krone	3,21 %	8,50
Polnischer Zloty	2,25 %	7,16
Britisches Pfund	4,79 %	9,22
Südafrikanischer Rand	9,92 %	16,01
Südkoreanischer Won	1,89 %	1,28
US-Dollar	4,53 %	16,36
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		
Euro	3,08 %	7,14
Britisches Pfund	4,51 %	5,76
US-Dollar	5,28 %	12,75
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,36 %	5,04
Indische Rupie	7,20 %	5,61
Jamaika-Dollar	9,25 %	5,68
Mexikanischer Peso	7,02 %	4,48
Britisches Pfund	5,65 %	2,36
US-Dollar	6,81 %	8,46
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]		
US-Dollar	6,12 %	19,36
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]		
US-Dollar	4,99 %	24,13
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]		
Brasilianischer Real	10,52 %	6,58
Indische Rupie	7,22 %	5,61
US-Dollar	4,40 %	15,62

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

(c) Zinsrisiko – (Fortsetzung)

Zum 28. Februar 2025 – (Fortsetzung)

Währung	Gewichtete durchschnittliche Rendite	Gewichteter Durchschnitt Jahre bis Fälligkeit
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	4,24 %	5,07
Kolumbianischer Peso	11,55 %	17,25
Mexikanischer Peso	9,70 %	24,28
Britisches Pfund	4,19 %	19,85
US-Dollar	4,46 %	16,55
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]		
Brasilianischer Real	13,02 %	8,55
Kolumbianischer Peso	11,77 %	24,81
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,21
Mexikanischer Peso	9,83 %	28,44
Südafrikanischer Rand	11,08 %	23,01
US-Dollar	6,08 %	22,59
FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]		
Euro	8,42 %	4,35
Britisches Pfund	4,49 %	3,26
US-Dollar	7,15 %	4,95
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund		
Australischer Dollar	4,23 %	1,14
Brasilianischer Real	13,01 %	8,56
Kanadischer Dollar	0,00 %	0,19
Kolumbianischer Peso	10,12 %	12,20
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,21
Euro	0,00 %	0,13
Mexikanischer Peso	9,69 %	24,08
Britisches Pfund	3,75 %	27,83
Südafrikanischer Rand	11,08 %	23,01
US-Dollar	5,80 %	26,93
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Brasilianischer Real	10,79 %	1,84
Kolumbianischer Peso	8,37 %	6,07
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,18
Mexikanischer Peso	8,80 %	11,17
Britisches Pfund	4,68 %	28,67
US-Dollar	7,09 %	6,35
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]		
Ägyptisches Pfund	0,00 %	0,03
US-Dollar	7,81 %	5,51
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
US-Dollar	4,88 %	20,35
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Euro	2,50 %	3,10
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]		
Euro	3,65 %	4,11

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

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

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

Schätzung des beizulegenden Zeitwerts

Die Gesellschaft hat im Einklang mit FRS 102 beschlossen, die Bestimmungen zu Ansatz und Bewertung von International Accounting Standards („IAS“) 39 „Financial Instruments: Recognition and Measurement“ („IAS 39“) in der zur Anwendung in der Europäischen Union übernommenen Fassung und die Offenlegungsbestimmungen der Abschnitte 11 und 12 von FRS 102 anzuwenden.

Der beizulegende Zeitwert von Finanzinstrumenten, die an aktiven Märkten gehandelt werden (z. B. börsengehandelte Derivate und Wertpapiere), basiert auf den Kursnotierungen am Bilanzstichtag. Steht für ein Wertpapier keine „jederzeit verfügbare Marktnotierung“ zur Verfügung, wendet die Gesellschaft „Marktwertmethoden“ an, um den Preis des Wertpapiers zu bestimmen. Generell handelt es sich beim beizulegenden Zeitwert um den Preis, mit dessen Erzielung der Fonds bei einem sofortigen Verkauf in angemessener Weise rechnen darf. Bei der Bewertung zum beizulegenden Zeitwert muss der Bewertungsausschuss ausgehend von den jeweiligen Fakten und Umständen den Wert eines bestimmten Wertpapiers oder einer Gruppe von Wertpapieren in gutem Glauben bestimmen.

Umstände, unter denen keine jederzeit verfügbare Marktnotierung zur Verfügung steht, beinhalten unter anderem die Aussetzung des Handels vor der Schließung des betreffenden Marktes; Ereignisse, die unerwartet zur Schließung ganzer Märkte führen, wie beispielsweise Naturkatastrophen, Stromausfall oder ähnliche schwerwiegende Ereignisse; Feiertage ohne Handel oder das Handelsvolumen für ein bestimmtes Wertpapier.

Bei der Bestimmung des beizulegenden Zeitwerts eines Portfoliowertpapiers kann der Bewertungsausschuss alle relevanten Methoden berücksichtigen, unter anderem eine oder sämtliche der nachfolgend aufgeführten Preisbestimmungsmethoden:

- (i) Gewinnkennzahlen,
- (ii) Marktabschlag eines ähnlich frei gehandelten Wertpapiers,
- (iii) Diskontierte Cashflow-Analyse,
- (iv) Buchwert oder Verhältniswert,

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

- (v) Risikoaufschlag/Renditeanalyse,
- (vi) Rendite bis zur Fälligkeit und/oder
- (vii) Fundamentale Investmentanalyse.

Der Bewertungsausschuss überprüft jeden Monat die Angemessenheit und Richtigkeit der für die Ermittlung des beizulegenden Zeitwerts von Wertpapieren eingesetzten Methoden. Unter anderem vergleicht er dabei die jeweiligen beizulegenden Zeitwerte mit dem letzten Marktpreis und dem nächsten verfügbaren Marktpreis, beispielsweise dem Eröffnungskurs des Folgetages.

Die Gesellschaft hat die Bewertungen zum Marktwert im Rahmen einer Marktwertthierarchie klassifiziert, die die Signifikanz von Inputs reflektiert, die bei einer Bewertung zum Marktwert herangezogen werden. Die Marktwertthierarchie kennt folgende Stufen:

Eingabewerte der Stufe 1 sind unbereinigte notierte Kurse in aktiven Märkten für gleichartige Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten, welche dem Unternehmen am Bewertungstag zugänglich sind.

Eingabewerte der Stufe 2 sind andere notierte Kurse als die in aktiven Märkten der Stufe 1, welche für die betreffenden Vermögenswerte und Verbindlichkeiten direkt oder indirekt beobachtbar sind (d. h. unter Verwendung von Marktdaten entwickelt werden).

Eingabewerte der Stufe 3 sind nicht beobachtbare Parameter für die Vermögenswerte oder Verbindlichkeiten (d. h., es sind keine Marktdaten verfügbar).

Jede Kapitalanlage wird insgesamt stets der Stufe 1, 2 oder 3 zugeordnet. In bestimmten Fällen kann zur Bewertung des beizulegenden Zeitwerts einer Kapitalanlage eine Reihe verschiedener Parameter verschiedener Stufen der Bewertungshierarchie herangezogen werden. In diesen Fällen richtet sich die Stufe der Kapitalanlage nach der geringsten Bewertungsstufe der Eingabewerte, die für die Berechnung des beizulegenden Zeitwerts herangezogen werden. Die Beurteilung der Bedeutsamkeit eines bestimmten Eingabewerts für die Bewertung zum beizulegenden Zeitwert erfordert Urteilsvermögen und ist anlagenspezifisch.

Die Eingabewerte oder die verwendete Methode zur Bewertung der Wertpapiere sind nicht unbedingt ein Hinweis auf die Risiken, die mit einer Anlage in diesen Wertpapieren verbunden sind.

Die folgende Tabelle schlüsselt die zum beizulegenden Zeitwert bewerteten finanziellen Vermögenswerte zum 28. Februar 2026 gemäß den Bewertungsstufen auf:

	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Bond Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US High Yield Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	45	301
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	117	271	13	34
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-24	-225	-220	–
	–	93	46	-162	335
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 1.441.979	\$ 75.635	\$ 176.425	\$ 176.240	\$ 75.836
Geldmarktinstrumente	626.087	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	2.644	11	14	1.990
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	101	441	398	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-96	-485	-1.349	-24
	2.068.066	78.284	176.392	175.303	77.803
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 109	\$ –	\$ 1.333
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	109	–	1.333
Anlagen insgesamt	\$ 2.068.066	\$ 78.377	\$ 176.547	\$ 175.141	\$ 79.471

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Bond Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	288	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	15	28	22	177	12
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-39	–	-558	-114	-25
	264	28	-536	63	-13
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 38.405	\$ 120.866	\$ 178.788	\$ 90.025	\$ 9.894
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	6	653	2.559	7.377	81
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	33	251	330	219	47
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-17	-88	-1.566	-954	-133
	38.427	121.682	180.111	96.667	9.889

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Western Asset Global High Yield Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Bond Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Global Credit Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 38.691	\$ 121.710	\$ 179.575	\$ 96.730	\$ 9.876

	FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	396	11.337	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	366	12	360	79	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-6	-504	-311	-95	–
	756	10.845	49	-16	–

Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 313.789	\$ 484.794	\$ 1.266.668	\$ 17.163	\$ 46.772
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	42	20.876	111.548	1.171	837
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	757	884	–	153	136
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-5.205	-858	–	-65	-728
	309.383	505.696	1.378.216	18.422	47.017

Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 2.458	\$ 12.599	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	2.458	12.599	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 312.597	\$ 529.140	\$ 1.378.265	\$ 18.406	\$ 47.017

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	110	27	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-135	–	–	–	–
	-25	27	–	–	–

Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 44.511	\$ 64.155	\$ 194.838	\$ 686.664	\$ 34.432
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.275	4.359	6.138	50.159	732
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	642	52	1.790	416	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-577	-8	-1.616	-2.467	–
	45.851	68.558	201.150	734.772	35.164

Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 45.826	\$ 68.585	\$ 201.150	\$ 734.772	\$ 35.164

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^] zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Value Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Putnam US Research Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	67.456	617.248	1.417.760	1.388.368	37.646
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-289	–	–
	67.456	617.248	1.417.471	1.388.368	37.646
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ 2.957	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.994	–	26.454	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	8	54	1.162	3
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	-335	-1.759	-525	-7
	1.994	-327	27.706	637	-4
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 69.450	\$ 616.921	\$ 1.445.177	\$ 1.389.005	\$ 37.642

	FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^] zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^] zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	615.331	192.610	1.198.977	399.732	7.908
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	615.331	192.610	1.198.977	399.732	7.908
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	9	11	1.119	94	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-2.612	-11	-319	-340	–
	-2.603	–	800	-246	–
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	€ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 612.728	\$ 192.610	€ 1.199.777	\$ 399.486	\$ 7.908

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Royce US Smaller Companies Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Franklin MV European Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Franklin MV Global Equity Growth and Income Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.035.267	87.279	5.069	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	1.035.267	87.279	5.069	–	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	53.733	2.023	157	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	92	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-1.239	-14	–	–	–
	52.586	2.009	157	–	–
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 1.087.853	\$ 89.288	\$ 5.226	€ –	\$ –

	FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2028 Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Franklin Responsible Income 2029 Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	€ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	20.063	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	20.063	–	–	–	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ 70.490	€ 35.094	€ 4.907	\$ 1.257.672
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	295.549
Eigenkapitalinstrumente	510	–	–	–	24
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	1
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	-1
	510	70.490	35.094	4.907	1.553.245
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	€ –	€ –	€ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 20.573	€ 70.490	€ 35.094	€ 4.907	\$ 1.553.245

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Putnam US Large Cap Value Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Putnam Balanced Fund^ zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	FTGF Putnam Global Healthcare Fund zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	272	71.958	494.290	134.881	3.774
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	-61	-8	–
	272	71.958	494.229	134.873	3.774
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 30.934	\$ –	\$ 1.353	\$ 79.178	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	1.064	1.999	39.566	–	176
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	12	4	112	9	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-368	-343	-494	-25	–
	31.642	1.660	40.537	79.162	176
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	–	–	–	–
Anlagen insgesamt	\$ 31.914	\$ 73.618	\$ 534.766	\$ 214.035	\$ 3.950

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

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

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

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global High Yield Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund^ zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Stufe 1					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	104	23	–	713	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-234	–	–	–	–
	-130	23	–	713	–
Stufe 2					
Anleihen und Schuldtitel	\$ 126.918	\$ 39.376	\$ 173.670	\$ 860.509	\$ 10.577
Anleihen und Schuldtitel	–	–	–	–	–
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	4.102	2.994	5.563	30.962	470
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	1.531	1	1.206	3.659	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	-2.008	-232	-1.908	-3.579	-80
	130.543	42.139	178.531	891.551	10.967
Stufe 3					
Anleihen und Schuldtitel	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Geldmarktinstrumente	–	–	–	–	–
Eigenkapitalinstrumente	–	47	–	–	13
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Vermögenswerte	–	–	–	–	–
Zu Handelszwecken gehaltene derivative Verbindlichkeiten	–	–	–	–	–
	–	47	–	–	13
Anlagen insgesamt	\$ 130.413	\$ 42.209	\$ 178.531	\$ 892.264	\$ 10980

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

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

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

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

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

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

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

Wertpapiere, die von der Verwaltungsgesellschaft oder dem jeweiligen Anlageverwalter am Ende des Geschäftsjahres zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden, sind im Anlageportfolio aufgeführt. Falls kein Preis von einem Preisberechnungsdienst verfügbar ist, kann der Bewertungsausschuss eine oder mehrere indikative Notierungen von zugelassenen Broker-Dealern einholen.

Matrixpreise werden für Fonds verwendet, wenn der Bewertungsausschuss nicht in der Lage ist, einen oder mehrere Broker-Dealer-Kurse für ein Wertpapier zu erhalten, für das kein Preis von einem Preisberechnungsdienst verfügbar ist. Bei der Matrix-Bewertung wird der aktuelle Marktwert eines auf US-Dollar lautenden Wertpapiers geschätzt, indem die letzte von einem Broker/Händler erhaltene Notierung verwendet und der Preis um die Veränderung der Rendite der US-Staatsanleihe mit der ähnlichsten Duration wie das zu bewertende Wertpapier angepasst wird.

Die folgenden Tabellen enthalten den Wert der Wertpapiere der einzelnen Fonds, deren Preise von einer einzigen Broker-Quelle bezogen wurden und die zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden:

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.1 Marktrisiko – (Fortsetzung)

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

	Single-Broker-Preis (in Tsd.)	Vom Bewertungsausschuss zum beizulegenden Zeitwert bewertet (in Tsd.)
Zum 28. Februar 2026		
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	109 \$	11 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	–	14 \$
FTGF Western Asset US High Yield Fund	812 \$	532 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	–	6 \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1.445 \$	1.055 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	12.599 \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	–	1 \$
Zum 28. Februar 2025		
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	271 \$	–
FTGF Western Asset US High Yield Fund	606 \$	310 \$
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	108 \$	–
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	1.730 \$	603 \$
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund [^]	–	16.263 \$
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund [^]	23 \$	–
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	–	47 \$
FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	–	13 \$
FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund [^]	–	15 \$

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

Nähere Angaben zu den zu Handelszwecken gehaltenen derivativen Vermögenswerten und Verbindlichkeiten, die zum 28. Februar 2026 zum beizulegenden Zeitwert bewertet wurden, sind dem Anlagenportfolio zu entnehmen.

Unter bestimmten Umständen verwendet die Gesellschaft angepasste Preise von ICE Data Services („ICE“) für die Bewertung von Nicht-US-Aktien. ICE berechnet und liefert einen angepassten Schlusskurs, der als Fair-Value-Preis zu verwenden ist.

Zum 28. Februar 2025 wurde die Preisanpassungsmethode von ICE angewendet auf den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^], FTGF ClearBridge US Value Fund, FTGF Putnam US Research Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^], FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund[^], FTGF Putnam US Large Cap Value Fund[^], FTGF Putnam Balanced Fund[^] und FTGF Putnam Global Healthcare Fund (28. Februar 2025: FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund, FTGF ClearBridge US Value Fund, FTGF ClearBridge US Appreciation Fund, FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund, FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund, FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund, FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund, FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund, FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund, FTGF ClearBridge Global Sustainability Improvers Fund[^], FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund, FTGF Royce US Smaller Companies Fund, FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^], FTGF Martin Currie Asia Long-Term Unconstrained Fund[^], Legg Mason Martin Currie European Absolute Alpha Fund[^], FTGF Martin Currie Global Long-Term Unconstrained Fund[^], FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^], FTGF Martin Currie European Unconstrained Fund[^] und FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^]).

12.2 Kreditrisiko

Das Kreditrisiko bezeichnet das Risiko, dass eine Gegenpartei oder der Emittent eines Finanzinstruments eine mit einem Fonds eingegangene Verpflichtung oder Verbindlichkeit nicht erfüllt. Die Gesellschaft ist bei den Parteien, mit denen sie Geschäfte abschließt, dem Kreditrisiko ausgesetzt und trägt darüber hinaus das Risiko des Zahlungsausfalls. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Untereinlageverwalter minimieren die Konzentration des Kreditrisikos, indem sie mit vielen Brokern und Kontrahenten an anerkannten und namhaften Börsen Geschäfte abschließen. Alle Transaktionen mit börsennotierten Wertpapieren werden bei Auslieferung unter Inanspruchnahme zugelassener Broker abgerechnet bzw. bezahlt. Das Risiko eines Zahlungsausfalls gilt als äußerst gering, da die verkauften Wertpapiere erst ausgehändigt werden, wenn die Zahlung beim Makler eingegangen ist. Bei einem Kauf werden die Wertpapiere erst bezahlt, wenn sie beim Makler eingetroffen sind. Erfüllt eine Partei ihre Verpflichtungen nicht, kommt das Geschäft nicht zustande.

Jeder Fonds ist einem Kreditrisiko in Bezug auf die Gegenparteien ausgesetzt, mit denen er in Bezug auf Optionen, Terminkontrakte und andere Finanzderivate, die nicht an einer anerkannten Börse gehandelt werden, Geschäfte abschließt. Solche Instrumente genießen nicht den gleichen Schutz wie Teilnehmer, die an organisierten Börsen mit Swaps, Futures oder Optionen handeln, wie z. B. die Leistungsgarantie einer Börsenclearingstelle. Die Fonds sind der Möglichkeit der Insolvenz, des Konkurses oder des Ausfalls einer Gegenpartei ausgesetzt, mit der die Fonds solche Instrumente abschließen, was zu erheblichen Verlusten für die Fonds führen könnte.

Die Gesellschaft ist einem Kreditrisiko in Bezug auf die OTC-Gegenparteien ausgesetzt, mit denen sie Geschäfte abschließt. Alle OTC-Gegenparteien müssen die folgenden, in den Regulations festgelegten Kriterien erfüllen:

- (i) Die Gegenpartei ist ein Kreditinstitut gemäß Regulation 7 der UCITS Regulations der irischen Zentralbank oder eine Investmentgesellschaft, die in Übereinstimmung mit der Richtlinie für Märkte für Finanzinstrumente in einem EWR-Mitgliedstaat zugelassen oder ein Rechtsträger ist, welcher als „Consolidated Supervised Entity“ von der Securities and Exchange Commission reguliert wird.
- (ii) Die Gegenpartei hat ein Rating von mindestens A2 oder ein gleichwertiges Rating oder nach Ansicht des jeweiligen Anlageverwalters und/oder der Untereinlageverwalter ein implizites Rating von mindestens A2 oder ein gleichwertiges Rating.

Das Engagement gegenüber einzelnen Gegenparteien ist in der Regel auf 10 % des Nettoinventarwerts bei zugelassenen Kreditinstituten und 5 % des Nettoinventarwerts bei anderen Gegenparteien begrenzt.

Transaktionen mit Finanzderivaten werden in der Regel mit Gegenparteien abgewickelt, mit denen die Gesellschaft Globalverrechnungsverträge geschlossen hat. Globalverrechnungsverträge sehen bei einem Ausfall die Nettoverrechnung von Kontrakten für einen bestimmten Fonds mit demselben Kontrahenten vor. Das Kreditrisiko im Zusammenhang mit derivativen finanziellen Vermögenswerten, die einem Globalverrechnungsvertrag unterliegen, wird nur insoweit eliminiert, als die finanziellen Verbindlichkeiten gegenüber derselben Gegenpartei nach der Realisierung der Vermögenswerte verrechnet werden.

Transaktionen, die zu hohen nicht realisierten Gewinnen für einen Fonds führen, können es erforderlich machen, dass ein Fonds von einem Broker erhaltene Sicherheiten hält. In diesen Fällen wird das Kreditrisiko für den Fonds um den Wert der gehaltenen Sicherheiten reduziert. Für den Fall, dass ein Broker Konkurs anmeldet, sind in den USA (die Vorschriften können je nach Gerichtsbarkeit variieren) Sicherheiten, die in Verbindung mit bestimmten Finanzderivaten gestellt wurden, von der automatischen Vollstreckungssperre („automatic stay“) zu Beginn eines Konkursverfahrens ausgenommen. Diese Ausnahmeregelung für Finanzderivate würde es einem Fonds ermöglichen, die von der insolventen Partei gestellten Sicherheiten sofort zu verwerten, um die Forderungen gegenüber dieser insolventen Partei zu befriedigen.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

Der Wert der als Sicherheiten im Zusammenhang mit dem Derivatehandel erhaltenen Wertpapiere, die von den folgenden Fonds gehalten werden, lautete zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025 wie folgt:

Fonds	Broker	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
		Marktwert der Sicherheiten in Tsd.	Marktwert der Sicherheiten in Tsd.
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Morgan Stanley	13 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	JP Morgan	– \$	47 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	BNP Paribas	317 \$	– \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Goldman Sachs	307 \$	272 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	JP Morgan	395 \$	18 \$
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]	Morgan Stanley	703 \$	– \$

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

Die Gesellschaft überwacht ihr Risiko, indem sie in regelmäßigen Abständen die Kreditqualität und die Finanzlage der Gegenparteien, die die Fonds in Anspruch nehmen, überprüft. Die Fonds dürfen nur mit zugelassenen Gegenparteien Geschäfte abschließen. Es wird eine Liste der zugelassenen Gegenparteien geführt, und die Fonds dürfen nur mit diesen zugelassenen Gegenparteien Geschäfte abschließen. Aufnahmen in diese Liste werden vierteljährlich überprüft, und jährlich wird eine gründliche Neubewertung aller Gegenparteien vorgenommen. Die Überprüfung umfasst eine Analyse der Kapitaladäquanz, der Rentabilität, der Liquidität und gegebenenfalls anderer Faktoren betreffend die Gegenpartei.

Für ein effizientes Portfoliomanagement kann ein Fonds unter Einhaltung der von den UCITS Regulations der irischen Zentralbank festgelegten Bedingungen und Grenzen Pensionsgeschäfte und umgekehrte Pensionsgeschäfte sowie Wertpapierleihgeschäfte abschließen.

Bis zur Fälligkeit der Pensionsgeschäfte, umgekehrten Pensionsgeschäfte und Wertpapierleihgeschäfte, müssen die im Rahmen solcher Verträge oder Transaktionen erhaltenen Sicherheiten:

- (i) täglich zum Marktwert bewertet werden,
- (ii) jederzeit dem Wert des angelegten Betrags oder der verliehenen Wertpapiere entsprechen oder diesen übersteigen,
- (iii) an den Treuhänder oder seinen Beauftragten übertragen werden und
- (iv) dem System bei einem Ausfall der Gegenpartei sofort und ohne Rückgriff auf diese zur Verfügung stehen.

Von der Gesellschaft erhaltene unbare Sicherheiten können nicht veräußert oder weiterverpfändet werden; sie müssen auf das Kreditrisiko der Gegenpartei angerechnet und von einer von der Gegenpartei unabhängigen Stelle ausgegeben werden. Das Kreditrisiko wird durch eine diversifizierte Inanspruchnahme von Gegenparteien und Emittenten sowie durch Mindestvorgaben für Ratings und durchschnittliche Portfolioratings gesteuert. Der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter können Portfoliolimits festlegen und auf der Grundlage interner Parameter investieren, wobei bei der Auflegung eines Fonds gemeinsam vereinbarte Limits festgelegt werden, einschließlich Emissions- und Emittentenbeschränkungen, Mindestratings und eine durchschnittliche Kreditqualität. Das Konto wird laufend überwacht, um sicherzustellen, dass es diese Parameter weiterhin erfüllt. Eine strenge unabhängige Analyse aller Schuldtitel vor dem Kauf, einschließlich Finanzmodellierung, Szenarioanalyse und Überwachung von Veränderungen im Risikoprofil, kann ebenfalls durchgeführt werden. Im Allgemeinen dürfen zum Zeitpunkt des Kaufs nicht mehr als 5 % des Portfolios in einen einzelnen Unternehmensemittenten investiert werden.

Der Bewertungsausschuss tritt mindestens einmal monatlich und immer dann, wenn es die Umstände erfordern, zusammen, um Bewertungsfragen, einschließlich des Kreditrisikos, zu prüfen und zu erörtern. Die jeweiligen Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter legen dem Verwaltungsrat und dem Ausschuss halbjährlich Risikoanalysen vor.

Im Wesentlichen werden alle Barmittel und Wertpapiere der Fonds über die Verwahrstelle verwaltet, die ein Rating von AA- aufweist (28. Februar 2025: AA-). Die Rechte der Fonds an den von der Verwahrstelle gehaltenen Barmitteln können durch Konkurs oder Zahlungsunfähigkeit der Verwahrstelle verzögert oder eingeschränkt werden. Die Bonität der Verwahrstelle wird von renommierten Ratingagenturen als erstklassig eingestuft. Wenn sich die Bonität oder die Finanzlage der Verwahrstelle erheblich verschlechtert, können der jeweilige Anlageverwalter und/oder die Unteranlageverwalter die Barbestände auf eine andere Bank übertragen.

Alle Wertpapiere, die als Sicherheiten gestellt wurden, werden im Anlagenportfolio ausgewiesen. Barmittel und Barmitteläquivalente, die bei der Verwahrstelle gehalten werden, sowie Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung werden in der Bilanz ausgewiesen.

Wenn ein Fonds einer Gegenpartei Sicherheiten gestellt hat, kann dieser Fonds im Falle einer Insolvenz der Gegenpartei gemäß den Handelsvereinbarungen mit der Gegenpartei das Recht haben, diese gestellten Sicherheiten zurückzufordern. In der Praxis kann der Fonds jedoch versuchen, die Beträge, die er der Gegenpartei zur Begleichung offener Transaktionen schuldet, zu reduzieren, indem er die geschuldeten Beträge mit den gestellten Sicherheiten verrechnet. Wenn dem Fonds nach Verrechnung mit den geschuldeten Beträgen Sicherheiten zurückfallen (z. B. wenn die Position des Fonds überbesichert wäre), hätte der Fonds im Insolvenzverfahren wahrscheinlich einen ungesicherten Anspruch gegen die Gegenpartei auf den ihm zustehenden Überschussbetrag.

Um das Kontrahenten-Kreditrisiko zu mindern, werden bestimmte außerbörslich gehandelte Derivate über zentrale Clearingstellen abgewickelt. Im Rahmen dieser Regelung werden die mit den Gegenparteien abgeschlossenen Geschäfte an die Clearingstellen weitergegeben, die nach ihrer Annahme die Gegenpartei in Bezug auf die Risikoaspekte des Geschäfts ersetzen.

Die folgende Tabelle zeigt den Marktwert der Wertpapiere, die im Zusammenhang mit dem Derivatehandel als Sicherheiten bei Brokern hinterlegt wurden, zum 28. Februar 2026 und 28. Februar 2025:

Fonds	Broker	Zum 28. Februar 2026	Zum 28. Februar 2025
		Marktwert der Sicherheiten in Tsd.	Marktwert der Sicherheiten in Tsd.
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Bank of America Merrill Lynch	193 \$	– \$
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Citi	– \$	14 \$
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Goldman Sachs	87 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Citi	145 \$	37 \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Goldman Sachs	101 \$	– \$
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	JP Morgan	17 \$	– \$
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	85 \$	– \$
FTGF Putnam US Research Fund	Bank of America Merrill Lynch	2.629 \$	– \$
FTGF Putnam US Research Fund	State Street Bank & Trust Co	152 \$	– \$
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund [^]	HSBC	194 \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	1.003 \$	– \$
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]	Morgan Stanley	111 \$	– \$
FTGF Putnam Balanced Fund [^]	Bank of America Merrill Lynch	315 \$	– \$

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

Die nachfolgenden Tabellen enthalten eine Zusammenfassung des Kreditrisikos, das auf der Bonität der in den Rentenfonds gehaltenen Schultitel basiert:

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund			FTGF Western Asset US Core Bond Fund			FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund			FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AAA	53,36 %	100,00 %	AAA	13,33 %	60,00 %	AAA	12,88 %	52,01 %	AAA	6,79 %	31,83 %
AA	46,64 %	–	AA	53,50 %	8,04 %	AA	45,23 %	7,96 %	AA	18,83 %	1,38 %
			A	17,40 %	15,03 %	A	14,42 %	12,85 %	A	9,22 %	7,60 %
			BBB	15,45 %	16,61 %	BBB	20,81 %	18,38 %	BBB	39,75 %	31,96 %
			BB	0,32 %	0,32 %	BB	4,07 %	5,40 %	BB	17,92 %	17,31 %
						B	0,62 %	1,39 %	B	5,79 %	7,38 %
						CCC & niedriger	1,85 %	2,01 %	CCC & niedriger	1,67 %	2,54 %
						Kein Rating	0,12 %	–	Kein Rating	0,03 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund			FTGF Western Asset Global High Yield Fund			FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund			FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AA	0,64 %	–	BBB	11,07 %	7,71 %	AAA	8,68 %	5,06 %	AAA	0,20 %	2,03 %
BBB	7,99 %	7,09 %	BB	40,72 %	42,23 %	AA	13,40 %	17,14 %	AA	35,25 %	24,39 %
BB	35,75 %	34,49 %	B	30,67 %	31,56 %	A	49,02 %	50,67 %	A	64,55 %	73,58 %
B	34,14 %	38,40 %	CCC & niedriger	17,24 %	18,50 %	BBB	28,85 %	27,13 %			
CCC & niedriger	21,08 %	19,94 %	Kein Rating	0,30 %	–	Kein Rating	0,05 %	–			
Kein Rating	0,40 %	0,08 %									
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]			FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]			FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund ^{^β}		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AAA	9,68 %	32,73 %	AAA	4,83 %	4,96 %	AAA	7,82 %	7,03 %	AAA	4,89 %	10,54 %
AA	37,88 %	14,05 %	AA	8,19 %	6,90 %	AA	4,54 %	1,23 %	AA	7,12 %	0,61 %
A	30,94 %	31,97 %	A	31,09 %	33,25 %	A	3,74 %	4,09 %	A	13,58 %	7,65 %
BBB	14,77 %	14,96 %	BBB	51,77 %	46,66 %	BBB	25,59 %	26,10 %	BBB	17,84 %	17,90 %
BB	6,51 %	5,65 %	BB	3,48 %	7,39 %	BB	29,10 %	32,83 %	BB	21,57 %	15,66 %
CCC & niedriger	0,22 %	0,64 %	B	0,64 %	0,84 %	B	19,29 %	18,63 %	B	13,17 %	15,89 %
						CCC & niedriger	9,78 %	10,09 %	CCC & niedriger	21,33 %	31,75 %
						Kein Rating	0,14 %	–	Kein Rating	0,50 %	–
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund [^]			Western Asset UCITS SMASH Series Core Plus Completion Fund [^]			FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund			FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^]		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AAA	3,43 %	98,63 %	AAA	1,14 %	51,54 %	AAA	12,13 %	2,70 %	AAA	8,99 %	–
AA	94,42 %	0,25 %	AA	60,78 %	3,53 %	AA	73,58 %	90,99 %	AA	36,95 %	42,29 %
A	1,71 %	0,83 %	A	11,71 %	13,58 %	A	3,15 %	–	A	7,38 %	7,90 %
BBB	0,20 %	0,20 %	BBB	14,61 %	18,30 %	BBB	4,54 %	6,31 %	BBB	17,62 %	21,64 %
BB	–	0,09 %	BB	9,58 %	11,78 %	BB	3,50 %	–	BB	18,18 %	17,51 %
Kein Rating	0,24 %	–	B	2,12 %	0,88 %	Kein Rating	3,10 %	–	B	10,60 %	10,66 %
			CCC & niedriger	0,05 %	0,39 %				CCC & niedriger	0,28 %	–
			Kein Rating	0,01 %	–						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %
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 [^]		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AA	0,22 %	1,11 %	AAA	8,11 %	13,08 %	AAA	0,95 %	–	A	–	3,50 %
A	–	0,35 %	AA	58,10 %	59,14 %	AA	3,78 %	3,35 %	BBB	–	16,95 %
BBB	7,37 %	6,52 %	A	3,15 %	2,07 %	A	8,57 %	1,13 %	BB	–	24,26 %
BB	57,33 %	37,58 %	BBB	8,09 %	11,33 %	BBB	26,72 %	29,45 %	B	–	44,86 %
B	29,52 %	49,89 %	BB	14,34 %	8,39 %	BB	33,78 %	33,50 %	CCC & niedriger	–	10,43 %
CCC & niedriger	5,56 %	4,55 %	B	5,21 %	5,99 %						
			Kein Rating	3,00 %	–	B	19,19 %	23,74 %			
						CCC & niedriger	6,92 %	8,83 %			
						Kein Rating	0,09 %	–			
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		0,00 %	100,00 %
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]			Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]			Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]			FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund [^]		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
AA	92,07 %	90,88 %	AAA	0,56 %	–	A	30,68 %	22,36 %	A	5,90 %	–
A	1,82 %	1,91 %	AA	2,82 %	2,67 %	BBB	54,51 %	54,14 %	BBB	32,83 %	–
BBB	6,11 %	6,67 %	A	42,40 %	36,28 %	BB	12,28 %	18,57 %	BB	41,23 %	–
BB	–	0,54 %	BBB	46,36 %	52,06 %	B	2,53 %	4,93 %	B	20,04 %	–
			BB	7,86 %	7,44 %						
			B	–	1,55 %						
	100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	100,00 %		100,00 %	0,00 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoeexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.2 Kreditrisiko – (Fortsetzung)

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund^			FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^			FTGF Putnam Balanced Fund^		
Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25	Rating	Feb-26	Feb-25
A-1	3,45 %	–	A	0,30 %	–	AA	69,75 %	–
A-2	12,37 %	–	BBB	8,87 %	–	A	7,72 %	–
AAA	2,48 %	–	BB	61,78 %	–	BBB	20,79 %	–
AA	21,16 %	–	B	23,06 %	–	BB	1,74 %	–
A	48,06 %	–	CCC & niedriger	4,84 %	–			
BBB	12,48 %	–	Kein Rating	1,15 %	–			
	100,00 %	0,00 %		100,00 %	0,00 %		100,00 %	0,00 %

β Das Portfolio wird nach dem Bottom-up-Prinzip unter Anwendung des Fundamentalwertverfahrens von Western Asset zusammengestellt. Das Anlagenteam verlässt sich nicht auf die Analysen der Rating-Agenturen, bewertet jedoch deren Arbeit und die Verbesserungsniveaus der Wertpapiere. Bei Wertpapieren, die nicht von einer national anerkannten statistischen Rating-Organisation (NRSRO) bewertet werden, vergibt das Anlagenteam ein internes Rating, das auf der Fundamentalanalyse des Anlageteams beruht.

12.3 Liquiditätsrisiko

Der Verkaufsprospekt der Gesellschaft sieht die tägliche Ausgabe und Einziehung von Anteilen vor. Daraus resultiert für die Gesellschaft ein Liquiditätsrisiko, da sie die Rücknahmen von Anteilshabern jederzeit erfüllen muss.

Die Verwaltungsstelle überwacht täglich die Zeichnungs- und Rücknahmeverolumina und benachrichtigt den jeweiligen Anlageverwalter oder Unteranlageverwalter gegebenenfalls über signifikante Bewegungen und ungewöhnliche Trends. Wenn die Rücknahmeanträge an einem Handelstag (wie im Prospekt definiert) 10 % der für einen Fonds ausgegebenen Anteile übersteigen, kann die Gesellschaft beschließen, die Gesamtzahl der an diesem Handelstag zurückgenommenen Anteile auf 10 % der im Umlauf befindlichen Anteile des Fonds zu beschränken; in diesem Fall werden alle betreffenden Rücknahmeanträge anteilig reduziert. Die Gesellschaft schiebt die überzähligen Rücknahmeanträge auf und behandelt die aufgeschobenen Anträge so, als ob sie für jeden folgenden Handelstag eingegangen wären (für den die Gesellschaft die gleiche Aufschiebungsbefugnis zu dem dann geltenden Grenzwert hat), bis alle Anteile, auf die sich der ursprüngliche Antrag bezieht, zurückgenommen wurden. In diesen Fällen kann die Gesellschaft die Anträge am nächsten und den folgenden Handelstagen anteilig kürzen, um die oben genannte Beschränkung umzusetzen.

Die Gesellschaft kann die Bestimmung des Nettoinventarwerts eines Fonds sowie den Verkauf oder die Rücknahme von Anteilen vorübergehend in jedem Zeitraum aussetzen:

- (i) während dessen ein Markt, welcher der wichtigste Markt für einen erheblichen Teil der Anlagen eines Fonds ist, geschlossen ist oder solange der Handel darauf eingeschränkt oder einstweilen ausgesetzt ist;
- (ii) während dessen eine Notlage besteht, infolge derer ein Fonds Anlagen, die einen wesentlichen Teil des Vermögens eines Fonds darstellen, praktisch nicht veräußern kann;
- (iii) während dessen die Preise von Anlagen eines Fonds aus irgendeinem Grund vom Fonds nicht angemessen, unverzüglich oder exakt ermittelt werden können;
- (iv) während dessen die Überweisung von Mitteln, die für Käufe und Verkäufe von Fondsanlagen benötigt werden, nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht zu üblichen Wechselkursen erfolgen kann; oder
- (v) während dessen der Erlös aus dem Verkauf oder der Rücknahme von Anteilen nicht auf das Konto eines Fonds oder von diesem Konto überwiesen werden kann.

Die Gesellschaft ist berechtigt, zur Sicherstellung der Abwicklung kurzfristige Kredite aufzunehmen. Gemäß den UCITS Regulations darf ein Fonds nur wie folgt Geld aufnehmen:

- (a) Ein Fonds darf im Rahmen von Parallelkrediten („Back-to-back“) Fremdwährungen kaufen.
- (b) Ein Fonds darf Geld aufnehmen:
 - (i) bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts, sofern eine solche Kreditaufnahme vorübergehend erfolgt, und
 - (ii) bis zu 10 % seines Nettovermögenswerts, sofern die Kreditaufnahme den Erwerb von Grundstücken ermöglichen soll, die für die Ausübung seiner Tätigkeit erforderlich sind,

vorausgesetzt, dass die unter Buchstabe b) Ziffern i) und ii) genannten Kreditaufnahmen insgesamt 15 % des Vermögens des Kreditnehmers nicht überschreiten.

Weltweite Kreditlinie (Global Credit Facility)

Die Gesellschaft nahm zusammen mit anderen in Europa und den Vereinigten Staaten eingetragenen Investmentfonds, die von Franklin Templeton Investments verwaltet werden (einzelne „der Kreditnehmer“; gemeinsam „die Kreditnehmer“), eine gemeinsame, syndizierte, vorrangige unbesicherte Kreditlinie in der Gesamthöhe von 2.675 Millionen USD auf (wirksam bis 30. Januar 2026, erhöht auf 2.995 Mio. USD mit Wirkung vom 30. Januar 2026, die „Global Credit Facility“), um für die Kreditnehmer eine Geldquelle zu schaffen, aus der sie vorübergehend und in Notfällen schöpfen können, wozu auch die Fähigkeit zählt, künftige unvorhergesehene oder ungewöhnlich umfangreiche Rücknahmeanträge bedienen zu können.

Gemäß den Bedingungen der weltweiten Kreditlinie hat die Gesellschaft, zusätzlich zu den Zinsen für jeden seitens der Gesellschaft aufgenommenen Kreditbetrag und anderen seitens der Gesellschaft entstandenen Kosten, ihren Anteil an den Gebühren und Kosten zu tragen, die im Zusammenhang mit der Einführung und Aufrechterhaltung der weltweiten Kreditlinie entstehen, und zwar auf der Grundlage ihres relativen Anteils am Gesamtvermögen aller Kreditnehmer, einschließlich einer jährlichen Bereitstellungsgebühr, die auf dem Anteil des nicht genutzten Teils dieser weltweiten Kreditlinie beruht.

Alle Fonds der Gesellschaft, mit Ausnahme des FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund, fallen in den Anwendungsbereich der weltweiten Kreditlinie.

Eine der Aufgaben des Bewertungsausschusses ist die Überprüfung und Beratung bei Bewertungsfragen, einschließlich illiquider Wertpapiere. Die Gesellschaft kann von Zeit zu Zeit in außerbörslich gehandelte Derivatkontrakte investieren, die nicht an einem organisierten öffentlichen Markt gehandelt werden und illiquide sein können. Infolgedessen ist die Gesellschaft möglicherweise nicht in der Lage, ihre Anlagen in diesen Instrumenten schnell zu einem Betrag zu liquidieren, der ihrem Marktwert nahe kommt, um ihren Liquiditätsbedarf zu decken oder auf bestimmte Ereignisse wie die Verschlechterung der Kreditwürdigkeit eines bestimmten Emittenten zu reagieren.

Die umseitigen Tabellen wurden auf der Grundlage der nicht abgezinsten Bruttomittelabflüsse für die jeweiligen finanziellen Verbindlichkeiten erstellt. Die in den nachstehenden Tabellen aufgeführten Devisenterminkontrakte werden auf Bruttobasis abgewickelt. Nähere Angaben zu den Bruttoabrechnungsbeträgen dieser Kontrakte finden Sie im jeweiligen Anlagenportfolio.

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

[Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen]

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Nachfolgend eine Auflistung der vertraglichen Fälligkeiten der finanziellen Verbindlichkeiten der einzelnen Fonds:

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund		FTGF Western Asset US Core Bond Fund		FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund		FTGF Western Asset Euro Core Plus Bond Fund [^]	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 48	\$ 116	\$ –	\$ –	€ –	€ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	156	324	102	692	–	–
Optionen	–	–	–	77	–	190	–	–
Swapkontrakte	–	–	60	190	88	706	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	238	84	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	65	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	24.733	785	6.253	13.634	51.223	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	4.020	3.908	93	107	85	97	–	–
Fällige Managementgebühr	911	785	45	58	104	148	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	49	41	12	13	19	24	–	3
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	3	5	7	8	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	20	28	984	357	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	2.067.766	1.680.756	78.302	97.902	176.744	248.773	–	–
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	30	–	74	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	55	212	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	1.266	–	–	–	–
Optionen	–	–	7	48	17	73	–	–
Swaptions	–	–	36	–	85	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	19	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	17	20	143	634	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	273	236	176	117	439	346	54	51
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 2.073.019	\$ 1.710.459	\$ 79.760	\$ 106.554	\$ 192.828	\$ 303.641	€ 54	€ 54

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	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 [^]		FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ 197	\$ 49
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	1
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	6	176
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	13	12
Fällige Managementgebühr	–	–	–	–	–	–	51	94
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	–	–	–	–	15	19
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	8	12
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	1	1	–	–	–	–	89	280
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	123.058	192.959
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	82	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	14	14	17	17	8	8	257	170
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 15	\$ 15	\$ 17	\$ 17	\$ 8	\$ 8	\$ 123.776	\$ 193.772

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

Legg Mason Western Asset Short Duration High Income Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund		FTGF Western Asset US High Yield Fund		Legg Mason Western Asset Emerging Markets Total Return Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global High Yield Fund	
zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
\$ –	\$ –	\$ 163	\$ –	\$ –	\$ 296	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
–	–	23	73	34	93	–	–	7	99
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	601	–	2	20	–	–	–	–
–	–	597	968	22	5	–	–	17	52
–	–	155	220	–	–	–	–	39	–
–	–	747	829	1.277	1.762	–	–	816	1.214
–	–	53	68	109	149	–	–	38	59
–	–	99	107	60	59	–	–	30	30
–	–	19	22	12	12	–	–	10	9
–	–	7	7	6	3	–	–	1	–
661	661	63	13	118	971	11	11	421	38
–	–	187.436	241.323	79.676	86.953	–	–	38.759	40.789
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	11	–	–	–	–
–	–	151	102	–	–	–	–	–	13
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	65	312	–	–	–	–	–	–
7	10	225	151	104	80	13	13	93	92
\$ 668	\$ 671	\$ 190.404	\$ 244.195	\$ 81.420	\$ 90.414	\$ 24	\$ 24	\$ 40.231	\$ 42.395
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]		FTGF Western Asset Macro Opportunities Bond Fund [^]		FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	
zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
\$ 1	\$ 4	\$ –	\$ –	\$ 13	\$ 129	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
61	45	52	276	6	88	–	–	549	241
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
263	240	–	–	50	119	–	–	645	774
1.066	12	838	777	56	1	–	–	4.361	250
414	–	37	140	19	12	–	–	–	336
1.897	–	6.035	9.619	79	668	–	–	6.224	4.039
1	1	–	–	–	–	–	–	–	–
65	65	6	9	–	–	–	–	41	38
19	18	12	12	7	8	–	3	27	33
6	7	–	–	–	–	–	–	–	–
540	1.345	–	2	–	2	2.867	2.653	30	12
182.127	178.663	98.024	97.331	10.429	27.126	–	–	337.637	407.023
–	–	5	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
237	144	111	177	27	20	–	–	187	380
–	–	–	96	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	12	–
144	218	77	123	6	2	–	–	6	92
190	133	187	112	100	66	2.582	1.400	247	186
\$ 187.031	\$ 180.895	\$ 105.384	\$ 108.674	\$ 10.792	\$ 28.241	\$ 5.449	\$ 4.056	\$ 349.966	\$ 413.404

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Western Asset 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 [^]	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 3.892	\$ –	\$ –	\$ –	£ –	£ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	199	1.668	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	844	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	14	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	195.053	171.974	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	6	15	17	14	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	40	40	84	87	–	–	–	3
Fällige Informationsstellengebühren	1	1	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	528.780	515.202	1.245.056	1.220.387	–	–	–	–
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	21.032	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	504	1.088	311	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	388	319	321	258	33	35	–	44
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 534.469	\$ 516.665	\$1.441.041	\$1.415.420	£ 33	£ 35	–	\$ 47

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	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 [^]	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ 617	\$ 260	\$ 3	\$ –	\$ 132	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	1.170	270	590	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	239	–	80	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	877	1.367	2.053	2.653	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	3.318	–	6.310	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	69	128	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	98	93	405	533	–	5	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	19	19	54	70	5	8	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	1	–	42	57	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	2	293	2.263	–	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	199.227	179.505	736.518	915.084	–	10.897	–	–
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	650	520	88	687	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	89	21	326	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	404	136	557	245	110	87	–	–
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 205.853	\$ 182.550	\$ 747.565	\$ 921.962	\$ 115	\$ 11.209	–	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund [^]		FTGF ClearBridge US Value Fund		Legg Mason ClearBridge Growth Fund [^]		FTGF Putnam US Research Fund	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 6	\$ –	\$ 1.039	\$ 5.207	\$ –	\$ –	\$ 3	\$ 398
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	47	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	335	2	–	–	1.651	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	289	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	430	791	–	–	405	185
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	15	–	68	100	–	–	96	23
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	49	94	–	–	19	23
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	2.009	9.226	17	17	3.215	261
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	69.402	–	622.905	1.215.369	–	–	1.472.870	181.760
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	108	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	137	–	251	164	–	–	190	112
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 69.560	–	\$ 627.086	\$ 1.230.953	\$ 17	\$ 17	\$ 1.478.893	\$ 182.762

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]		FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund [^]		FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	€ 1	€ 1	\$ 6	\$ 2	\$ –	\$ 3	\$ 3	\$ 28
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	319	1.195	340	69	–	–	1.239	117
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	43.758	–	29.209	–	–	–	–	408
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	946	598	301	253	–	–	904	928
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	85	57	30	33	6	28	85	85
Fällige Informationsstellengebühren	135	81	36	31	–	–	154	166
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	917	1.257	1.384	2.150	–	–	3.642	3.853
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	1.239.110	734.171	418.091	287.149	8.453	6.699	1.087.660	984.334
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	18	–	–	–	–	–	37
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	208	172	653	94	62	21	266	192
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	€ 1.285.479	€ 737.550	\$ 450.050	\$ 289.781	\$ 8.521	\$ 6.751	\$ 1.093.953	\$ 990.148

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^		FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	
zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
\$ 368	\$ 3	\$ –	\$ 143	\$ –	\$ –	\$ 652	\$ 5	\$ 1	\$ –
860	2.000	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
525	71	–	46	7	10	2.612	3	11	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	1.625	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
915	1.319	–	183	34	35	251	399	166	13
122	166	6	36	10	9	63	85	19	8
128	162	–	27	4	3	25	47	23	–
1.928	2.998	–	518	–	36	1.219	2.729	21	–
1.399.554	1.999.981	–	176.729	38.884	40.436	628.416	921.356	194.253	27.329
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	1.283	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
377	289	200	214	97	67	301	257	71	47
\$ 1.404.777	\$ 2.008.272	\$ 206	\$ 177.896	\$ 39.036	\$ 40.596	\$ 633.539	\$ 924.881	\$ 196.190	\$ 27.397

FTGF Royce US Smaller Companies Fund		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 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
\$ 40	\$ 309	\$ –	\$ 11	\$ –	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
14	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	47	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
97	97	–	–	–	–	–	–	–	–
16	14	7	6	–	–	–	–	–	–
15	13	–	–	–	–	–	–	–	–
137	151	–	–	–	–	1.142	1.193	2.211	2.213
89.622	82.853	5.170	4.322	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
100	78	64	44	23	23	415	389	13	26
\$ 90.041	\$ 83.515	\$ 5.241	\$ 4.430	\$ 23	\$ 23	€ 1.557	€ 1.582	\$ 2.224	\$ 2.239

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	Legg Mason 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 [^]	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	¥ –	¥ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	59	59	1	1	2.518	2.516	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	–	–	–	–	–	–
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	2	2	38	38	36	36	131.395	126.767
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 61	\$ 61	\$ 39	\$ 39	\$ 2.554	\$ 2.552	¥ 131.395	¥ 126.767

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Martin Currie Asia Pacific Urban Trends Income Fund [^]		FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]		FTGF Franklin European Unconstrained Fund [^]		FTGF Martin Currie Improving Society Fund [^]	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ –	\$ –	\$ 9	\$ –	€ –	€ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	125	–	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	–	–	7	19	–	24	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	2	2	9	9	5	13	5	42
Fällige Informationsstellengebühren	–	–	–	–	–	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	34	39	–	4	–	46
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	–	–	20.281	31.953	–	83.017	–	15.536
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	15	21	260	161	88	57	50	66
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 17	\$ 23	\$ 20.600	\$ 32.306	€ 93	€ 83.115	\$ 55	\$ 15.690

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

12. Risikoexposition und Risikomanagement – (Fortsetzung)

12.3 Liquiditätsrisiko – (Fortsetzung)

Verbindlichkeiten (in Tsd.)	FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund [^]		FTGF Putnam US Large Cap Value Fund [^]		FTGF Putnam Balanced Fund [^]		FTGF Putnam Global Healthcare Fund	
	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025	zum 28. Februar 2026	zum 28. Februar 2025
Weniger als 1 Monat								
Überziehung (Barmittel)	\$ 24	\$ –	\$ 774	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –	\$ –
Einschusskonten und Barmittel mit Verfügungsbeschränkung	–	–	29	–	3	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swapkontrakte	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	343	–	494	–	16	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	61	–	8	–	–	–
Verbindlichkeiten für erworbene Anlagen	–	–	–	–	13.799	–	–	–
Ausschüttungen an Inhaber von rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	–	–	–	–	–	–	–	–
Fällige Managementgebühr	37	–	229	–	237	–	–	–
Verbindlichkeiten aus Verwaltungs- und Verwahrstellengebühren	10	–	39	–	20	–	6	–
Fällige Informationsstellengebühren	5	–	16	–	9	–	–	–
Verbindlichkeiten aus zurückgekauften rückkaufbaren gewinnberechtigten Anteilen	98	–	23.411	–	50	–	–	–
Rückkaufbare und gewinnberechtigte Anteile	73.446	–	517.030	–	220.444	–	3.929	–
1-3 Monate								
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	9	–	–	–
Über 3 Monate								
Leerverkaufte Wertpapiere	–	–	–	–	–	–	–	–
Optionen	–	–	–	–	–	–	–	–
Swaptions	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Devisenterminkontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Nicht realisierte Wertminderung aus Futures-Kontrakten	–	–	–	–	–	–	–	–
Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten	25	–	19	–	39	–	24	–
Finanzielle Verbindlichkeiten insgesamt	\$ 73.988	–	\$ 542.102	–	\$ 234.634	–	\$ 3.959	–

13. Angaben zu Kreuzbeteiligungen von Fonds innerhalb der Gesellschaft

Bestimmte Fonds können in andere Fonds der Gesellschaft investieren. Diese Kreuzbeteiligungen werden im Jahresabschluss der Gesellschaft wie folgt eliminiert:

- Die Marktwerte der zugrunde liegenden Organismen für gemeinsame Anlagen werden in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft in der Bilanz eliminiert.
- Die realisierten Gewinne und Verluste, einschließlich der Veränderungen bei den nicht realisierten Gewinnen und Verlusten, sowie die entsprechenden Dividendenerträge und Ausschüttungen aus den Kreuzbeteiligungen werden in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Gesamtergebnisrechnung ausgewiesen werden, eliminiert.
- Die Geldbeträge der Käufe und Verkäufe von Anteilen an solchen Organismen für gemeinsame Anlagen werden von den Nettoerlösen aus Anteilsverkäufen bzw. den Kosten der zurückgeworbenen Anteile in den Gesamtbeträgen der Gesellschaft, die in der Entwicklung des auf die Inhaber rückkaufbarer gewinnberechtigter Anteile entfallenden Nettovermögens ausgewiesen sind, abgezogen.

FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^]

Der FTGF Brandywine Global Enhanced Absolute Return Fund[^] hielt null (2025: null) Anteile am FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] am Ende des Geschäftsjahres. Die Transaktionen mit Anteilen des zugrunde liegenden Fonds und die damit verbundenen Gewinne im vergangenen Geschäftsjahr stellten sich wie folgt dar:

	FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund [^]	
	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026 (in Tsd.)	Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2025 (in Tsd.)
Ausgabe von Anteilen	– \$	– \$
Rücknahme von Anteilen	–	-4.023
Realisierter Nettogewinn aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	–	523
Erhaltene Ausschüttungen	–	–
Kosten	–	–
Beizulegender Zeitwert	–	–
Nicht realisierter Nettogewinn/-verlust aus zum beizulegenden Zeitwert ergebniswirksam bewerteten Finanzanlagen	– \$	– \$

14. Bedeutende Ereignisse

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

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

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

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

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

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

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Erläuterungen zum Abschluss – (Fortsetzung)

14. Bedeutende Ereignisse – (Fortsetzung)

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

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

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

Mit Wirkung vom 7. Juli 2025 stellte der FTGF Martin Currie Improving Society Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 14. Juli 2025 wurden ein ergänzender Prospekt für Franklin Templeton Global Funds plc, ein Sonderprospekt und Nachträge für den FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] und FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^] von der Gesellschaft herausgegeben und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen.

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

Mit Wirkung vom 4. August 2025 stellte der FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 18. August 2025 stellte der FTGF Franklin European Unconstrained Fund[^] den Handel ein.

Mit Wirkung vom 30. September 2025 wurde der FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund[^] in FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^] umbenannt. Am gleichen Datum gab die Gesellschaft einen Nachtrag zum Prospekt heraus, der die Namensänderung widerspiegelt und von der Zentralbank zur Kenntnis genommen wurde. Mit Wirkung vom selben Datum löste ClearBridge Investment Management Limited Martin Currie Investment Management Limited als Anlageverwalter ab.

Mit Wirkung vom 22. Oktober 2025 veranlasste die Verwaltungsgesellschaft eine Sachübertragung von rund 90 Mio. USD und führte eine Rücknahme in Sachwerten aus dem FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^] – Klasse Premier USD Thesaurierend durch. Gleichzeitig wurde der gleiche Betrag in Form einer Sacheinlage in den FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – Klasse P2 USD Thesaurierend gezeichnet.

Am 31. Oktober 2025 wurden von der Gesellschaft ein ergänzender Prospekt und ein aktualisierter Prospekt für Franklin Templeton Global Funds Plc herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 31. Oktober 2025 wurde der FTGF Western Asset Global Core Plus Bond Fund[^] in FTGF Western Asset Global Bond Fund[^] umbenannt. An diesem Datum gab die Gesellschaft eine Prospektergänzung heraus, die die Namensänderung widerspiegelt und die die irische Zentralbank förmlich genehmigt hat.

Mit Wirkung vom 31. Oktober 2025 wurde der FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund[^] mit dem FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund verschmolzen.

Mit Wirkung vom 26. November 2025 wurden von der Gesellschaft ein ergänzender Prospekt für Franklin Templeton Global Funds plc und ein Nachtrag für den FTGF Pathway to Putnam US Research Fund herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 12. Januar 2026 stellte der FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained[^] den Handel ein.

Am 30. Januar 2026 gab die Gesellschaft einen ergänzenden Prospekt für Franklin Templeton Global Funds plc heraus, der von der Zentralbank genehmigt wurde. Am gleichen Datum wurde der FTGF Franklin Responsible Income Series 3 Fund in FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund umbenannt (mit Wirkung vom 30. Januar 2026). Mit Wirkung zum selben Datum gab die Gesellschaft die folgenden Fondsnachträge heraus, die jeweils von der Zentralbank genehmigt wurden: FTGF Putnam US Research Fund[^], FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund[^] und FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^].

Mit Wirkung vom 17. Februar 2026 nahm der FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] den Handel auf.

Während des Geschäftsjahres zum 28. Februar 2026 fanden keine sonstigen bedeutenden Ereignisse statt.

15. Getrennte Haftung

Die Gesellschaft ist ein Umbrella-Fonds mit getrennt haftenden Fonds. Daher können die Vermögenswerte der einzelnen Fonds nach irischem Recht nicht für Verbindlichkeiten der anderen Fonds der Gesellschaft herangezogen werden. Ungeachtet der obigen Ausführungen kann nicht garantiert werden, dass die getrennte Haftung der Teilfonds im Fall einer Klage gegen die Gesellschaft vor einem Gericht eines anderen Rechtssystems Bestand hat.

16. Ereignisse nach dem Stichtag

Mit Wirkung vom 9. März 2026 wurden von der Gesellschaft ein ergänzender Prospekt für Franklin Templeton Global Funds plc und ein Nachtrag für den FTGF Putnam Global Convertibles Fund[^] herausgegeben und von der Zentralbank genehmigt.

Mit Wirkung vom 6. März 2026 nahm der FTGF Pathway to Putnam US Research Fund den Handel auf.

Am 7. Mai 2026 wurden die Genehmigungen für den FTGF Western Asset Sustainable Global Corporate Bond Fund[^], den FTGF Brandywine Global Defensive High Yield Fund[^] und den FTGF Brandywine Global Dynamic US Equity Fund[^] auf Antrag der Gesellschaft von der Zentralbank widerrufen.

Mit Wirkung vom 8. Mai 2026 wurde der FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund mit dem FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund verschmolzen.

Mit Wirkung vom 15. Juni 2026 nahm der FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^] den Handel eingestellt.

Western Asset Management Company, LLC („Western Asset“), eine hundertprozentige Tochtergesellschaft von Franklin Resources, Inc., die als diskretionärer Anlageverwalter und/oder Unteranlageverwalter für bestimmte Teilfonds der Gesellschaft tätig ist, erhielt Mitteilungen über Ermittlungen des US-Justizministeriums und der US- Securities and Exchange Commission („SEC“) bezüglich mutmaßlicher Verstöße gegen bestimmte Gesetze im Zusammenhang mit Handelszuteilungen durch Ken Leech, den ehemaligen Co-Chief Investment Officer von Western Asset. Das US-Justizministerium hat Western Asset mitgeteilt, dass das Unternehmen nicht mehr Gegenstand seiner Ermittlungen ist und keine weiteren Maßnahmen ergriffen werden. Am 4. Juni 2026 schloss Western Asset einen Vergleich mit der SEC, wodurch die Ermittlungen der SEC vollständig beigelegt wurden (der „Vergleich“). Gemäß den Bedingungen des Vergleichs hat sich Western Asset – ohne ein Fehlverhalten einzugestehen – bereit erklärt, eine Zivilstrafe in Höhe von 100 Millionen Dollar zu zahlen.

Es gab keine weiteren wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag, die eine Offenlegung im Jahresabschluss erfordern.

17. Genehmigung des Jahresberichts und des geprüften Abschlusses

Der Verwaltungsrat genehmigte den Jahresbericht und den geprüften Abschluss am 16. Juni 2026.

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Ergänzende Informationen – Gesamtkostenquoten (TER) (ungeprüft)

**Verhältnis
Gesamtbetriebsaufwand in
RE (1) zum durchschnittlichen
täglichen Nettovermögen des
Fonds in RE (1)(%)
Für das Geschäftsjahr zum
28. Februar 2026****

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Klasse A USD Thesaurierend	0,65
Klasse A USD Ausschüttend (D)	0,65
Klasse C USD Thesaurierend	1,35
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,41
Klasse A (G) USD Thesaurierend	0,65
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	0,65
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	0,68

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,10
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,10
Klasse C USD Thesaurierend	1,60
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,60
Klasse E USD Thesaurierend	1,76
Klasse F USD Thesaurierend	0,76
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,61
Klasse X USD Thesaurierend	0,60
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,60
Klasse GA USD Thesaurierend	1,03

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,30
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,30
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,30
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,30
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,30
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,54
Klasse C USD Thesaurierend	1,80
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,80
Klasse E USD Thesaurierend	1,95
Klasse F USD Thesaurierend	0,75
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,75
Klasse X USD Thesaurierend	0,65
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,48
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	0,50
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,19
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,35
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,35
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,85
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	1,85

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,40
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,44
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,44
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,40
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,44
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,44
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,44
Klasse A GBP ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,44
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,44
Klasse A ZAR ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,44
Klasse B USD Ausschüttend (D)	1,69
Klasse C USD Thesaurierend	1,90
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,94
Klasse E USD Thesaurierend	2,04
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,03
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,04
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	2,04
Klasse F USD Thesaurierend	0,84
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,84
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,89
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,89
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,59
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	0,59
Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,55
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,55
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,58
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,59
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,59
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	0,55
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,45
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15

**Verhältnis
Gesamtbetriebsaufwand in
RE (1) zum durchschnittlichen
täglichen Nettovermögen des
Fonds in RE (1)(%)
Für das Geschäftsjahr zum
28. Februar 2026****

FTGF Western Asset US High Yield Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,25
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
Klasse C USD Thesaurierend	1,75
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,75
Klasse E USD Thesaurierend	1,91
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,90
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,90
Klasse F USD Thesaurierend	0,91
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,91
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,61
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,61
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	0,45
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,45
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,15
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,36
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,36
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,86
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	1,86
Klasse GF USD Thesaurierend	1,11

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,25
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,25
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
Klasse A EUR Thesaurierend	1,25
Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	1,25
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,25
Klasse C USD Thesaurierend	1,75
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,75
Klasse E USD Thesaurierend	2,04
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,03
Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	2,02
Klasse F USD Thesaurierend	1,02
Klasse F USD Ausschüttend (D)	1,02
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,94
Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	0,93
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,78
Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	0,77
Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	0,35
Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,35
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,58
Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	1,58
Klasse L (G) USD Thesaurierend	2,07
Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	2,07

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

Klasse A USD Thesaurierend	1,46
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,47
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,46
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,46
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,46
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,46
Klasse A EUR Thesaurierend	1,46
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,44
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,46
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,40
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,46
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,47
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	1,46
Klasse C USD Thesaurierend	1,96
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,96
Klasse E USD Thesaurierend	2,06
Klasse E USD Ausschüttend (D)	2,06
Klasse F USD Thesaurierend	1,06
Klasse F USD Ausschüttend (D)	1,06
Klasse X USD Ausschüttend (M)	0,90
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,80
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,81
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	0,81
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	0,81
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)	0,81

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

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund		FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,17	Klasse A USD Thesaurierend	1,42
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,17	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,43
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,17	Klasse A USD Ausschüttend (S)	1,42
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,17	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,45
Klasse C USD Thesaurierend	1,67	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,43
Klasse E USD Thesaurierend	1,77	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,44
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,77	Klasse A EUR Ausschüttend (S)	1,43
Klasse F USD Thesaurierend	0,77	Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,42
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,18	Klasse A GBP ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,42
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,65	Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,42
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,50	Klasse A SGD Thesaurierend	1,41
Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,50	Klasse B USD Thesaurierend	1,72
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,50	Klasse C USD Thesaurierend	1,97
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,50	Klasse C USD Ausschüttend (S)	1,97
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,50	Klasse E USD Thesaurierend	2,06
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,40	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,06
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,40	Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	1,03
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,40	Klasse X USD Thesaurierend	0,92
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,40	Klasse X USD Ausschüttend (S)	0,92
		Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,87
		Klasse X GBP Thesaurierend	0,94
		Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,94
		Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	0,92
		Klasse Premier USD Thesaurierend	0,78
		Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	0,78
		Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,94
		Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,78
		Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,77
		Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,77
		Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	0,79
		Klasse LM USD Thesaurierend	0,34
FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]		FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^]	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,20	Klasse A USD Thesaurierend	1,74
Klasse X USD Thesaurierend	0,70	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,74
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,58	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,72
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,58	Klasse C USD Thesaurierend	2,24
Klasse P1 USD Thesaurierend	0,45	Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,34
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45	Klasse X USD Thesaurierend	1,20
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	0,22	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,20
		Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,30
		Klasse Premier USD Thesaurierend	1,11
		Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,10
		Klasse LM USD Thesaurierend	0,24
FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]		FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]	
Klasse A USD Thesaurierend	1,18	Klasse A USD Thesaurierend	1,40
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,18	Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,40
Klasse X USD Thesaurierend	1,04	Klasse F USD Thesaurierend	0,90
Klasse LM USD Thesaurierend	0,33	Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,90
		Klasse Premier USD Thesaurierend	0,75
		Klasse P2 USD Thesaurierend	0,48
		Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,48
		Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	0,48
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]		FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,55	Klasse A USD Thesaurierend	1,45
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,54	Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,45
Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)	0,54	Klasse A SGD Thesaurierend	1,45
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	0,54	Klasse C USD Thesaurierend	1,97
Klasse P2 CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)	0,54	Klasse E USD Thesaurierend	2,07
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,54	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,05
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,54	Klasse F USD Thesaurierend	1,07
Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	0,14	Klasse F USD Ausschüttend (M)	1,07
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,14	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,98
		Klasse Premier USD Thesaurierend	0,82
		Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,82
		Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	0,17
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]			
Klasse D USD Thesaurierend	1,48		
Klasse D USD Ausschüttend (M)	1,48		
Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,48		
Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,88		
Klasse M USD Ausschüttend (M)	0,88		
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,73		
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,73		
Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	0,73		
Klasse LM USD Thesaurierend	0,13		
FTGF Western Asset US Mortgage-Backed Securities Fund[^]			
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,28		
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,41		
Klasse LM USD Thesaurierend	0,11		
Western Asset UCITS SMASh Serie Core Plus Completion Fund[^]			
Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	/		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	1,39	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,39	
Klasse A USD Ausschüttend (D)	1,39	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,39	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,39	
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,39	
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,39	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,39	
Klasse A CZK thesaurierend (Abgesichert)	1,39	
Klasse A EUR Thesaurierend	1,40	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,39	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,39	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)	1,40	
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	1,40	
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,39	
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,39	
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,39	
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,39	
Klasse A HKD Thesaurierend	1,39	
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,39	
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,39	
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,39	
Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	1,39	
Klasse C USD Thesaurierend	1,89	
Klasse C USD Ausschüttend (D)	1,89	
Klasse E USD Thesaurierend	1,99	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,99	
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,99	
Klasse F USD Thesaurierend	0,94	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,94	
Klasse X USD Thesaurierend	0,74	
Klasse X USD Ausschüttend (D)	0,75	
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,74	
Klasse X EUR Thesaurierend	0,74	
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,74	
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,75	
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,74	
Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,74	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,59	
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,59	
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,59	
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,60	
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,59	
Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	0,59	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,49	
Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,49	
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,49	
Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,49	
Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,49	
Klasse LM USD Thesaurierend	0,14	
Klasse LM USD Ausschüttend (M)	0,14	
Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	0,10	
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	0,15	
Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,14	
Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,14	
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend	1,10	
Klasse P1 USD Thesaurierend	0,35	
FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend	1,80	
Klasse X USD Thesaurierend	1,15	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,80	
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,80	
Klasse LM NZD Thesaurierend	0,00	
FTGF ClearBridge US Value Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	1,83	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,83	
Klasse A EUR Thesaurierend	1,83	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,83	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,83	
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	1,83	
Klasse A SGD Thesaurierend	1,83	
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,83	
Klasse C USD Thesaurierend	2,33	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,33	
Klasse E USD Thesaurierend	2,58	
Klasse F USD Thesaurierend	1,23	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,23	
Klasse X USD Thesaurierend	0,98	
Klasse X USD Ausschüttend (A)	0,98	
Klasse X EUR Thesaurierend	0,98	
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,98	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,81	
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,81	
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,81	
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,81	
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,76	
Klasse S USD Thesaurierend	0,66	
Klasse S GBP Thesaurierend	0,64	
LM Klasse USD Ausschüttend (A)	0,13	
FTGF Putnam US Research Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	1,53	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,53	
Klasse A EUR Thesaurierend	1,52	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,49	
Klasse A HKD Thesaurierend	1,25	
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,25	
Klasse AX AUD Thesaurierend (Abgesichert)	0,79	
Klasse AX CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,79	
Klasse AX EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,79	
Klasse AX GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,79	
Klasse AX HKD Thesaurierend	0,79	
Klasse AX SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,79	
Klasse AX USD Thesaurierend	0,79	
Klasse C USD Thesaurierend	2,13	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,13	
Klasse D1 HKD Thesaurierend	0,90	
Klasse D1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,90	
Klasse D1 USD Thesaurierend	0,87	
Klasse D2 HKD Thesaurierend	1,15	
Klasse D2 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,15	
Klasse D2 USD Thesaurierend	1,12	
Klasse E USD Thesaurierend	2,38	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,38	
Klasse F USD Thesaurierend	1,13	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,13	
Klasse X USD Thesaurierend	0,55	
Klasse X USD Ausschüttend (A)	0,69	
Klasse X EUR Thesaurierend	0,61	
Klasse X GBP Thesaurierend	0,55	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,56	
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,63	
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,53	
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,50	
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,50	
Klasse S USD Thesaurierend	0,39	
Klasse S EUR Thesaurierend	0,39	
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,39	
Klasse S GBP Thesaurierend	0,39	
Klasse P1 USD Thesaurierend	0,29	
Klasse P1 AUD Thesaurierend (Abgesichert)	0,29	
Klasse P1 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,29	
Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,29	
Klasse P1 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,29	
Klasse P1 HKD Thesaurierend	0,29	
Klasse P1 SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,29	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,31	
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,31	
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,31	
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,31	
Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,31	
Klasse LM USD Thesaurierend	0,13	
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,38	
Klasse B (G) USD Thesaurierend	1,88	
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,88	
Klasse GA USD Thesaurierend	1,55	
Klasse GA EUR Thesaurierend	1,55	
Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	1,55	
Klasse GE USD Thesaurierend	2,30	
Klasse GE EUR Thesaurierend	2,30	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**		Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund		FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,72	Klasse A USD Thesaurierend	1,78
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,72	Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,78
Klasse A EUR Thesaurierend	1,72	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,72	Klasse A CHF Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,75	Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse B USD Thesaurierend	2,21	Klasse A EUR Thesaurierend	1,78
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,22	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse C USD Thesaurierend	2,22	Klasse A GBP Thesaurierend	1,78
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,22	Klasse A HKD Thesaurierend	1,78
Klasse E USD Thesaurierend	2,47	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,47	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,78
Klasse F USD Thesaurierend	1,12	Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,25
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,12	Klasse C USD Thesaurierend	2,28
Klasse X USD Thesaurierend	1,04	Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,28
Klasse X EUR Thesaurierend	1,04	Klasse E USD Thesaurierend	2,53
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,04	Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,53
Klasse X GBP Thesaurierend	1,04	Klasse E EUR Thesaurierend	2,53
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,75	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,53
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,75	Klasse F USD Thesaurierend	1,18
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,75	Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,18
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,75	Klasse X USD Thesaurierend	0,80
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,75	Klasse X USD Ausschüttend (A)	0,80
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	0,75	Klasse X EUR Thesaurierend	0,80
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,75	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,80
Klasse S USD Thesaurierend	0,65	Klasse X GBP Thesaurierend	0,80
Klasse S USD Ausschüttend (Q)	0,65	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,78
Klasse S EUR Thesaurierend	0,65	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,75
Klasse LM USD Thesaurierend	0,12	Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,75
Klasse LM EUR Thesaurierend	0,12	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,75
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,37	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	0,75
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,87	Klasse P2 USD Thesaurierend	0,44
Klasse GA USD Thesaurierend	1,54	Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,45
Klasse GA EUR Thesaurierend	1,54	Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,43
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund		Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,43
Klasse A USD Thesaurierend	1,75	Klasse B (G) USD Thesaurierend	1,92
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,75	Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,93
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,75	Klasse GA EUR Thesaurierend	1,55
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,75	Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	1,55
Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1,75	Klasse GE USD Thesaurierend	2,30
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,75	Klasse GE EUR Thesaurierend	2,30
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,75	FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund[^]	
Klasse A EUR Thesaurierend	1,75	Klasse A USD Thesaurierend	1,97
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,75	Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	1,97
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,75	Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,75	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,97
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,75	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	1,97
Klasse C USD Thesaurierend	2,14	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,14	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	1,97
Klasse C USD Ausschüttend (Q)	2,14	Klasse A EUR Thesaurierend	1,97
Klasse F USD Thesaurierend	1,15	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	1,97
Klasse F EUR Thesaurierend	1,15	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,97
Klasse F EUR Ausschüttend (A)	1,15	Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	1,97
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	1,00	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,97
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund		Klasse C USD Thesaurierend	2,47
Klasse A USD Thesaurierend	1,68	Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	2,47
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,68	Klasse E USD Thesaurierend	2,72
Klasse A EUR Thesaurierend	1,70	Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	2,72
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,68	Klasse E EUR Thesaurierend	2,72
Klasse A SEK Thesaurierend	1,50	Klasse E EUR Ausschüttend (A)	2,72
Klasse F USD Thesaurierend	1,08	Klasse F USD Thesaurierend	1,37
Klasse X USD Thesaurierend	0,98	Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	1,37
Klasse X USD Ausschüttend (A)	0,98	Klasse X USD Thesaurierend	1,07
Klasse X EUR Thesaurierend	0,98	Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,07
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,98	Klasse X EUR Thesaurierend	1,07
Klasse X GBP Thesaurierend	0,98	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	1,07
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,73	Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	1,07
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,73	Klasse Premier USD Thesaurierend	0,87
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,75	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,87
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,73	Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH)	0,87
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,53	Plus (e)	
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,53	Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,87
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,53	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	0,87
Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,53	Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,87
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,53	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	0,87
Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	0,53	Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	0,87
Klasse LM EUR Thesaurierend	0,13	Klasse S EUR Thesaurierend	0,72

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	1,91	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	1,91	
Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,92	
Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,91	
Klasse A CNH Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,90	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	1,91	
Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,91	
Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,91	
Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	1,92	
Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	1,91	
Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	1,14	
Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	1,15	
Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	1,14	
Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	1,14	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,88	
Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	0,89	
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,89	
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,90	
Klasse S USD Thesaurierend	0,73	
Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73	
Klasse S EUR Thesaurierend	0,73	
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,73	
Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73	
Klasse S GBP Thesaurierend	0,73	
Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,74	
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	0,73	
Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	0,73	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,53	
Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	0,54	
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend	1,80	
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,80	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,80	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,45	
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,45	
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,45	
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	1,98	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	1,98	
Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse A EUR Thesaurierend	1,98	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	1,98	
Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse A GBP Ausschüttend (A)	1,98	
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse A SGD Thesaurierend	1,98	
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,98	
Klasse B USD Thesaurierend	2,48	
Klasse B USD Ausschüttend (A)	2,48	
Klasse C USD Thesaurierend	2,48	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,48	
Klasse E USD Thesaurierend	2,73	
Klasse E USD Ausschüttend (A)	2,73	
Klasse E EUR Thesaurierend	2,73	
Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,73	
Klasse F USD Thesaurierend	1,38	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,38	
Klasse R EUR Thesaurierend	1,48	
Klasse X USD Thesaurierend	1,23	
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,23	
Klasse X EUR Thesaurierend	1,23	
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	1,23	
Klasse X GBP Thesaurierend	1,23	
Klasse X GBP Ausschüttend (A)	1,23	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,88	
Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	0,88	
Klasse Premier EUR Thesaurierend	0,88	
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,88	
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,88	
Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	0,88	
FTGF Royce US Smaller Companies Fund		
Klasse A USD Thesaurierend	2,00	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	2,05	
Klasse A EUR Thesaurierend	2,05	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	2,05	
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	2,05	
Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	1,61	
Klasse C USD Thesaurierend	2,50	
Klasse C USD Ausschüttend (A)	2,55	
Klasse E USD Thesaurierend	2,80	
Klasse E EUR Thesaurierend	2,80	
Klasse F USD Thesaurierend	1,45	
Klasse F USD Ausschüttend (A)	1,45	
Klasse X USD Ausschüttend (A)	1,30	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,95	
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,95	
Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	0,95	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,65	
Klasse A (G) USD Thesaurierend	1,45	
Klasse L (G) USD Thesaurierend	1,95	
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend	1,99	
Klasse X USD Thesaurierend	1,07	
Klasse X GBP Thesaurierend	1,06	
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,90	
FTGF ClearBridge 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 GBP Thesaurierend	0,90	
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,70	
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,70	
Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]		
Klasse A EUR Thesaurierend	0,75	
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	0,75	
Klasse D EUR Thesaurierend	1,30	
Klasse D EUR Ausschüttend (A)	1,30	
Klasse X EUR Thesaurierend	0,35	
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	0,35	
Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]		
Klasse A EUR Thesaurierend	0,75	
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	0,75	
Klasse X EUR Ausschüttend (A)	0,35	
FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]		
Klasse A EUR Thesaurierend	0,75	
Klasse A EUR Ausschüttend (M)	0,75	
Klasse A1 EUR Thesaurierend	1,05	
Klasse A1 EUR Ausschüttend (M)	1,05	
Klasse K EUR Thesaurierend	1,05	
Klasse K EUR Ausschüttend (M)	1,05	
Klasse X EUR Thesaurierend	0,45	
Klasse X EUR Ausschüttend (M)	0,45	
FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]		
Klasse A USD Thesaurierend	0,60	
Klasse A USD Ausschüttend (A)	0,60	
Klasse A USD Ausschüttend (D)	0,60	
Klasse A USD Ausschüttend (M)	0,60	
Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,60	
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,60	
Klasse AX USD Thesaurierend	0,85	
Klasse AX USD Ausschüttend (D)	0,85	
Klasse E USD Thesaurierend	1,35	
Klasse E USD Ausschüttend (D)	1,35	
Klasse F USD Thesaurierend	0,35	
Klasse F USD Ausschüttend (D)	0,35	
Klasse X USD Thesaurierend	0,35	
Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,35	
Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	0,35	
Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,35	
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,35	
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	0,35	
Klasse S USD Thesaurierend	0,25	
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,25	
Klasse LM USD Thesaurierend	0,05	

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

	Verhältnis Gesamtbetriebsaufwand in RE (1) zum durchschnittlichen täglichen Nettovermögen des Fonds in RE (1)(%) Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026**
FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund^	
Klasse A USD Ausschüttend (M)	1,40
Klasse B USD Ausschüttend (M)	1,65
Klasse C USD Ausschüttend (M)	1,90
Klasse F USD Ausschüttend (M)	0,95
Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	0,65
Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,65
Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,65
Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	0,65
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,50
FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^	
Klasse A USD Thesaurierend	1,70
Klasse X GBP Thesaurierend	0,76
Klasse S USD Thesaurierend	0,55
Klasse S EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,60
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,39
Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,40
FTGF Putnam US Large Cap Value Fund^	
Klasse A USD Thesaurierend	1,80
Klasse A EUR Thesaurierend	1,80
Klasse A EUR Ausschüttend (A)	1,80
Klasse C USD Thesaurierend	2,30
Klasse E USD Thesaurierend	2,55
Klasse F USD Thesaurierend	1,20
Klasse X USD Thesaurierend	0,89
Klasse X EUR Thesaurierend	0,86
Klasse X GBP Thesaurierend	0,86
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,78
Klasse Premier GBP Thesaurierend	0,83
Klasse S USD Thesaurierend	0,57
Klasse S GBP Thesaurierend	0,62
Klasse P2 USD Thesaurierend	0,51
Klasse P2 USD Ausschüttend (M)	0,55
Klasse P2 CHF Thesaurierend (Abgesichert)	0,50
Klasse P2 EUR Thesaurierend	0,50
Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	0,50
Klasse P2 GBP Thesaurierend	0,50
Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	0,55
FTGF Putnam Balanced Fund^	
Klasse A USD Thesaurierend	1,70
Klasse C USD Thesaurierend	2,04
Klasse D USD Thesaurierend	1,40
Klasse E USD Thesaurierend	2,45
Klasse F USD Thesaurierend	1,15
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,79
FTGF Putnam Global Healthcare Fund	
Klasse A USD Thesaurierend	1,85
Klasse A HKD Thesaurierend	1,85
Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	1,85
Klasse Premier USD Thesaurierend	0,80
Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	0,80
Klasse Premier SGD Thesaurierend (Abgesichert)	0,80

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.

Ergänzende Informationen – Daten zur Wertentwicklung der Fonds (ungeprüft)

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Klasse A USD Thesaurierend	08.05.2007	USD	3,57 %	3,69 %	13,45 %	19,66 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	3,57 %	3,69 %	13,45 %	19,63 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	2,84 %	2,97 %	11,10 %	14,23 %
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	10.10.2018	USD	3,82 %	3,92 %	14,16 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	3,56 %	3,69 %	13,45 %	19,66 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,57 %	3,69 %	13,46 %	19,63 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	3,57 %	3,68 %	13,46 %	19,65 %
FTGF Western Asset US Core Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	6,10 %	7,30 %	14,09 %	15,68 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	6,09 %	7,27 %	14,05 %	15,51 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	5,57 %	6,76 %	12,39 %	10,04 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	5,56 %	6,75 %	12,38 %	9,90 %
	Klasse E USD Thesaurierend	16.08.2019	USD	5,40 %	6,59 %	11,94 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	09.08.2013	USD	6,45 %	7,66 %	15,48 %	21,33 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	27.02.2017	USD	6,59 %	7,78 %	15,81 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	13.05.2016	USD	6,63 %	7,84 %	15,82 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	03.05.2016	USD	6,62 %	7,81 %	15,83 %	–
	Klasse GA USD Thesaurierend	27.08.2010	USD	6,17 %	7,37 %	14,41 %	17,96 %
FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	5,27 %	6,49 %	11,30 %	14,22 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	5,27 %	6,47 %	11,29 %	14,19 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19.02.2016	USD	5,28 %	6,49 %	11,31 %	14,21 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	19.02.2016	AUD	4,68 %	5,93 %	7,43 %	7,59 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.06.2018	EUR	2,97 %	4,15 %	4,53 %	–
	Klasse B USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	5,01 %	6,21 %	10,46 %	11,31 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	4,75 %	5,96 %	9,65 %	8,64 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,75 %	5,94 %	9,64 %	8,63 %
	Klasse E USD Thesaurierend	03.02.2012	USD	4,59 %	5,80 %	9,25 %	7,47 %
	Klasse F USD Thesaurierend	05.04.2013	USD	5,86 %	7,07 %	13,25 %	22,30 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	31.10.2018	USD	5,84 %	7,04 %	13,21 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	20.03.2015	USD	5,96 %	7,18 %	13,59 %	21,46 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	14.09.2010	USD	6,13 %	7,36 %	14,13 %	25,42 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	29.09.2011	USD	6,12 %	7,34 %	14,11 %	25,30 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.03.2016	EUR	4,56 %	5,88 %	8,71 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	19.11.2010	GBP	6,21 %	7,43 %	13,48 %	17,92 %
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	5,23 %	6,43 %	11,23 %	15,17 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	5,22 %	6,41 %	11,22 %	15,14 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	4,70 %	5,90 %	9,58 %	9,55 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	4,69 %	5,89 %	9,56 %	9,53 %
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	6,00 %	6,60 %	18,29 %	41,75 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	30.08.2002	USD	5,95 %	6,54 %	18,19 %	41,56 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	19.02.2008	USD	5,96 %	6,57 %	18,24 %	41,65 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19.01.2017	USD	6,00 %	6,61 %	18,29 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	19.01.2017	AUD	5,37 %	6,04 %	14,60 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.02.2008	EUR	3,64 %	4,27 %	11,25 %	15,67 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	28.04.2008	EUR	3,62 %	4,27 %	11,33 %	15,75 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	02.04.2013	EUR	3,69 %	4,31 %	11,36 %	15,74 %
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	29.05.2008	GBP	5,72 %	6,33 %	16,82 %	29,94 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	07.09.2017	HKD	6,63 %	6,82 %	17,94 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	26.05.2009	SGD	3,20 %	4,02 %	11,54 %	29,29 %
	Klasse A ZAR ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	26.04.2018	ZAR	8,49 %	9,28 %	27,77 %	–
	Klasse B USD Ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	5,69 %	6,29 %	17,25 %	38,01 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	5,48 %	6,07 %	16,53 %	34,84 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	24.02.2004	USD	5,42 %	6,01 %	16,44 %	34,62 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	5,33 %	5,92 %	16,13 %	33,41 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	5,30 %	5,87 %	16,05 %	33,27 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.05.2011	EUR	3,01 %	3,64 %	9,25 %	8,88 %
	Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	02.08.2013	EUR	3,03 %	3,64 %	9,32 %	9,04 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.02.2010	USD	6,60 %	7,21 %	20,38 %	50,42 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	6,58 %	7,19 %	20,34 %	50,33 %
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	03.07.2013	USD	6,53 %	7,12 %	20,09 %	49,42 %
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.02.2023	EUR	4,25 %	4,86 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	10.09.2008	USD	6,86 %	7,47 %	21,29 %	54,22 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M)	06.02.2009	USD	6,86 %	7,47 %	21,30 %	54,25 %
	Klasse Premier CHF Thesaurierend (Abgesichert)	01.12.2022	CHF	2,31 %	2,82 %	6,65 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	17.12.2009	EUR	4,54 %	5,15 %	14,15 %	25,95 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	23.11.2012	EUR	4,57 %	5,20 %	14,24 %	26,07 %

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	18.04.2008	GBP	6,67 %	7,29 %	19,84 %	41,53 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	05.02.2013	GBP	6,64 %	7,25 %	19,81 %	41,65 %
	Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	08.10.2015	PLN	7,43 %	8,22 %	24,32 %	60,04 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	14.08.2024	USD	7,14 %	7,70 %	–	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	03.12.2010	GBP	7,13 %	7,72 %	21,29 %	47,25 %
FTGF Western Asset US High Yield Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	8,01 %	9,34 %	31,00 %	80,17 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	7,98 %	9,29 %	30,87 %	79,76 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	20.12.2010	USD	8,01 %	9,33 %	31,00 %	80,14 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	8,01 %	9,33 %	31,00 %	80,17 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	19.12.2012	EUR	5,71 %	7,05 %	23,44 %	47,36 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	21.08.2023	HKD	8,38 %	9,27 %	–	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	31.01.2013	SGD	5,36 %	6,76 %	23,78 %	64,60 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	7,48 %	8,79 %	29,05 %	71,37 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	27.02.2004	USD	7,46 %	8,76 %	28,96 %	70,98 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	7,31 %	8,61 %	28,51 %	69,44 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	7,33 %	8,58 %	28,36 %	69,02 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	25.09.2019	EUR	5,01 %	6,32 %	20,99 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	8,38 %	9,70 %	32,42 %	89,61 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	04.01.2011	USD	8,36 %	9,66 %	32,23 %	88,63 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	08.11.2010	USD	8,70 %	10,04 %	33,54 %	94,52 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	09.08.2019	GBP	8,52 %	9,90 %	32,12 %	–
	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	09.03.2022	USD	8,98 %	10,29 %	34,56 %	–
	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	6,72 %	8,06 %	26,72 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	12.06.2020	GBP	8,95 %	10,29 %	33,64 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	7,89 %	9,21 %	30,64 %	81,21 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	7,88 %	9,17 %	30,54 %	80,81 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	7,36 %	8,67 %	28,70 %	72,37 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	7,35 %	8,64 %	28,61 %	71,99 %
	Klasse GF USD Thesaurierend	19.11.2010	USD	8,17 %	9,49 %	31,56 %	85,07 %
FTGF Western Asset Global High Yield Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,63 %	9,91 %	28,89 %	66,06 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	8,61 %	9,86 %	28,79 %	65,94 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	30.01.2008	USD	8,63 %	9,90 %	28,89 %	65,96 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	8,64 %	9,91 %	28,89 %	65,98 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.06.2010	AUD	7,88 %	9,19 %	24,67 %	55,62 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	23.05.2017	EUR	-4,64 %	-3,14 %	17,40 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (D) (Abgesichert)	25.09.2012	EUR	6,25 %	7,56 %	21,36 %	35,20 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	5,79 %	7,20 %	21,64 %	51,03 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	8,09 %	9,35 %	26,98 %	57,97 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	8,08 %	9,31 %	26,87 %	57,87 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	7,79 %	9,02 %	26,00 %	55,48 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	7,78 %	8,98 %	25,92 %	55,37 %
	Klasse E EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	02.08.2013	EUR	5,48 %	6,70 %	18,65 %	27,00 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	8,88 %	10,12 %	29,83 %	74,97 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	04.01.2011	USD	8,87 %	10,07 %	29,71 %	74,52 %
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	21.03.2018	USD	8,94 %	10,10 %	30,01 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	15.01.2013	GBP	8,67 %	9,92 %	28,51 %	59,83 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	12.10.2012	EUR	6,83 %	8,08 %	23,19 %	46,39 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (D) (Abgesichert)	12.08.2011	GBP	8,86 %	10,10 %	29,11 %	63,47 %
	Klasse P1 USD Ausschüttend (M)	09.03.2022	USD	9,73 %	11,02 %	32,64 %	–
	Klasse P1 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	7,45 %	8,74 %	24,81 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	8,28 %	9,52 %	27,71 %	65,65 %
	Klasse A (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	8,26 %	9,48 %	27,62 %	65,47 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	7,74 %	8,97 %	25,81 %	57,57 %
	Klasse L (G) USD Ausschüttend (D)	20.04.2007	USD	7,74 %	8,91 %	25,71 %	57,49 %
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund	Klasse A USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	7,23 %	6,38 %	12,76 %	27,46 %
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	02.07.2008	USD	7,24 %	6,37 %	12,78 %	27,38 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	07.01.2010	USD	7,24 %	6,39 %	12,77 %	27,47 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	21.11.2012	USD	7,24 %	6,38 %	12,76 %	27,47 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.09.2011	AUD	6,60 %	5,78 %	9,17 %	20,80 %
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	20.06.2013	CNH	4,35 %	3,76 %	3,99 %	29,57 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	02.07.2008	EUR	-5,86 %	-6,24 %	2,75 %	17,38 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.05.2011	EUR	4,81 %	3,96 %	6,04 %	3,85 %

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund – (Fortsetzung)	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	01.04.2011	EUR	-5,79 %	-6,17 %	2,85 %	17,38 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	27.10.2015	HKD	7,91 %	6,62 %	12,45 %	27,73 %
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	19.05.2009	SGD	4,43 %	3,74 %	6,36 %	16,02 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	18.01.2011	SGD	4,44 %	3,79 %	6,26 %	15,76 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	04.08.2010	SGD	0,40 %	0,16 %	8,15 %	14,05 %
	Klasse C USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	6,71 %	5,85 %	11,08 %	21,25 %
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	02.07.2008	USD	6,69 %	5,83 %	11,08 %	21,12 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	6,59 %	5,75 %	10,75 %	20,03 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	6,61 %	5,73 %	10,77 %	19,98 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.02.2010	USD	7,67 %	6,81 %	14,12 %	32,67 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	7,66 %	6,80 %	14,14 %	32,69 %
	Klasse X USD Ausschüttend (M)	07.05.2015	USD	7,84 %	6,97 %	14,53 %	34,13 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	02.07.2008	USD	7,93 %	7,07 %	14,97 %	36,02 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	03.09.2010	EUR	-5,24 %	-5,62 %	4,49 %	24,89 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	09.01.2013	EUR	-5,18 %	-5,56 %	4,81 %	25,17 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M)	08.09.2010	EUR	-5,23 %	-5,61 %	4,74 %	25,32 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M)	16.07.2010	GBP	0,76 %	-0,55 %	3,10 %	41,08 %
FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund	Klasse A USD Thesaurierend	25.06.2009	USD	4,75 %	5,01 %	15,69 %	20,52 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	02.06.2009	USD	4,74 %	5,01 %	15,69 %	20,54 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.01.2014	EUR	2,44 %	2,75 %	9,01 %	-1,03 %
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	23.06.2020	SEK	2,27 %	2,48 %	8,59 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	25.06.2009	USD	4,22 %	4,47 %	13,97 %	14,65 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	4,11 %	4,37 %	13,63 %	13,51 %
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	21.01.2010	USD	4,12 %	4,38 %	13,59 %	13,44 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.02.2010	USD	5,16 %	5,43 %	17,09 %	25,45 %
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	22.06.2020	USD	4,05 %	5,01 %	16,66 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	17.06.2020	EUR	3,06 %	3,32 %	10,66 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	02.06.2009	USD	5,45 %	5,72 %	18,00 %	28,92 %
	Klasse Premier CHF Ausschüttend (M) (Abgesichert)	17.07.2023	CHF	0,98 %	1,19 %	–	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	01.03.2019	EUR	3,14 %	3,45 %	11,20 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	02.06.2009	GBP	5,25 %	5,54 %	16,70 %	19,03 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	02.06.2009	GBP	5,37 %	5,62 %	16,85 %	19,29 %
	Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus (e)	15.12.2017	USD	5,55 %	5,83 %	18,36 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	15.10.2021	EUR	3,33 %	3,60 %	11,76 %	–
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	EUR	3,31 %	3,57 %	11,59 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	12.12.2017	GBP	5,37 %	5,66 %	17,07 %	–
FTGF Western Asset Global Bond Fund [^]	Klasse A USD Ausschüttend (A)	05.03.2015	USD	5,00 %	4,99 %	12,72 %	14,75 %
	Klasse X USD Thesaurierend	17.02.2015	USD	5,10 %	5,04 %	13,25 %	18,95 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	03.12.2010	USD	5,23 %	5,17 %	13,69 %	21,77 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	27.06.2014	EUR	3,02 %	2,96 %	6,89 %	-0,51 %
	Klasse P1 USD Thesaurierend	09.03.2022	USD	5,55 %	5,49 %	14,50 %	–
	Klasse P1 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	09.03.2022	EUR	3,20 %	3,20 %	7,66 %	–
	Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	17.10.2018	CAD	3,73 %	3,71 %	11,12 %	–
FTGF Western Asset Global Credit Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	15.11.2011	USD	5,58 %	6,32 %	17,04 %	31,67 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	15.11.2011	EUR	3,26 %	4,01 %	10,13 %	7,61 %
	Klasse X USD Thesaurierend	06.03.2023	USD	5,83 %	6,54 %	–	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	27.01.2011	USD	6,50 %	7,24 %	20,37 %	46,88 %
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund [^]	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	16.12.2015	USD	6,31 %	7,26 %	21,75 %	40,70 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.01.2017	EUR	3,50 %	4,42 %	13,71 %	–
	Klasse P2 JPY Thesaurierend (Abgesichert)	15.11.2024	JPY	2,71 %	3,44 %	–	–
	Klasse P2 CHF Ausschüttend (A)	26.11.2021	CHF	-8,95 %	-5,82 %	6,87 %	–
	Klasse P2 CHF Ausschüttend (A) (Abgesichert)	25.07.2022	CHF	2,43 %	3,30 %	9,68 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	18.11.2019	EUR	4,60 %	5,56 %	17,33 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	20.11.2019	GBP	6,67 %	7,65 %	23,06 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund^ – (Fortsetzung)	Klasse LM CAD Thesaurierend (Abgesichert)	28.02.2022	CAD	5,35 %	6,36 %	21,89 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	16.12.2015	GBP	7,08 %	8,05 %	24,49 %	45,91 %
FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund^	Klasse D USD Thesaurierend	24.01.2018	USD	5,11 %	5,98 %	23,05 %	–
	Klasse D USD Ausschüttend (M)	14.02.2018	USD	5,11 %	5,99 %	23,05 %	–
	Klasse D EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.05.2018	EUR	2,86 %	3,74 %	16,23 %	–
	Klasse M CHF Thesaurierend (Abgesichert)	30.05.2018	CHF	1,24 %	2,02 %	10,44 %	–
	Klasse M USD Ausschüttend (M)	28.11.2018	USD	5,75 %	6,63 %	25,27 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	04.05.2016	USD	5,92 %	6,79 %	25,85 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	04.05.2016	EUR	3,64 %	4,54 %	18,79 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert)	27.12.2017	EUR	3,72 %	4,63 %	18,88 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	13.01.2016	USD	6,55 %	7,43 %	28,12 %	76,09 %
FTGF Western Asset US Mortgage- Backed Securities Fund^	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	13.01.2016	USD	6,26 %	7,19 %	11,57 %	3,66 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	15.06.2022	USD	7,19 %	8,14 %	14,54 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	13.01.2016	USD	7,52 %	8,47 %	15,57 %	16,49 %
Western Asset UCITS SMASH Serie Core Plus Completion Fund^	Klasse LM USD Ausschüttend (Q)	11.01.2021	USD	6,48 %	8,43 %	14,15 %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	3,87 %	4,10 %	1,96 %	-6,61 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	06.12.2010	USD	3,89 %	4,11 %	1,96 %	-6,60 %
	Klasse A USD Ausschüttend (S)	01.10.2003	USD	3,88 %	4,09 %	1,95 %	-6,61 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.07.2014	AUD	3,36 %	3,61 %	-1,59 %	-14,12 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	19.02.2013	EUR	1,63 %	1,87 %	-4,47 %	-25,48 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	07.06.2013	EUR	1,60 %	1,84 %	-4,45 %	-25,50 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (S)	14.10.2016	EUR	-8,78 %	-8,23 %	-7,16 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (S) (Abgesichert)	31.05.2024	EUR	1,69 %	1,94 %	–	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	14.11.2014	GBP	3,67 %	3,79 %	0,22 %	-16,99 %
	Klasse A GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	31.05.2024	GBP	3,70 %	3,82 %	–	–
	Klasse A SGD Thesaurierend	08.06.2015	SGD	-2,85 %	-2,02 %	-2,37 %	-18,20 %
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	3,59 %	3,82 %	1,18 %	-8,92 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	3,32 %	3,54 %	0,41 %	-11,20 %
	Klasse C USD Ausschüttend (S)	24.02.2004	USD	3,31 %	3,54 %	0,40 %	-11,20 %
	Klasse E USD Thesaurierend	08.09.2011	USD	3,22 %	3,43 %	0,10 %	-12,08 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	31.05.2024	EUR	1,06 %	1,29 %	–	–
	Klasse R GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	31.05.2024	GBP	4,15 %	4,35 %	–	–
	Klasse X USD Thesaurierend	04.06.2013	USD	4,41 %	4,64 %	3,54 %	-1,79 %
	Klasse X USD Ausschüttend (S)	26.03.2013	USD	4,40 %	4,62 %	3,49 %	-1,83 %
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	28.06.2013	EUR	2,10 %	2,36 %	-3,03 %	-21,66 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	23.12.2014	GBP	-2,60 %	-2,86 %	-7,27 %	0,83 %
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	4,20 %	4,43 %	1,58 %	-13,00 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	25.02.2013	GBP	4,20 %	4,34 %	1,68 %	-12,88 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.03.2011	USD	4,55 %	4,77 %	3,96 %	-0,34 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (S)	24.02.2012	USD	4,69 %	4,78 %	3,95 %	-0,20 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	25.01.2011	EUR	-8,23 %	-7,67 %	-5,32 %	-8,68 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend (Abgesichert)	30.01.2013	EUR	2,31 %	2,58 %	-2,75 %	-20,64 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	15.09.2021	GBP	4,43 %	4,54 %	2,10 %	–
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	4,47 %	4,72 %	2,28 %	-11,46 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (S) (Abgesichert)	31.05.2024	GBP	4,40 %	4,63 %	–	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	28.03.2019	USD	5,00 %	5,27 %	5,70 %	–
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^	Klasse A USD Thesaurierend	03.04.2012	USD	8,83 %	9,72 %	10,02 %	21,67 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	17.09.2013	USD	8,84 %	9,72 %	10,03 %	21,75 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	18.06.2013	EUR	6,35 %	7,20 %	2,95 %	-1,71 %
	Klasse C USD Thesaurierend	17.07.2013	USD	8,29 %	9,18 %	8,39 %	15,70 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	27.08.2013	USD	8,18 %	9,06 %	8,06 %	14,58 %
	Klasse X USD Thesaurierend	16.03.2018	USD	9,42 %	10,29 %	11,65 %	–

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund [^] – (Fortsetzung)	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	16.06.2014	GBP	9,24 %	10,08 %	9,82 %	15,47 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	21.01.2014	GBP	9,11 %	9,97 %	9,61 %	15,24 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	25.03.2013	USD	9,49 %	10,38 %	12,02 %	29,17 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.07.2012	EUR	6,96 %	7,90 %	4,86 %	4,55 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	12.06.2014	USD	10,47 %	11,38 %	15,09 %	41,33 %
FTGF Brandywine Global High Yield Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	14.10.2016	USD	4,81 %	6,93 %	31,87 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	18.07.2016	USD	4,83 %	6,95 %	32,11 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	17.05.2024	USD	5,33 %	7,46 %	–	–
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	08.02.2024	USD	5,36 %	7,50 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	30.11.2012	USD	5,48 %	7,61 %	34,53 %	76,86 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	04.09.2024	USD	5,77 %	7,92 %	–	–
	Klasse P2 CAD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	23.02.2016	CAD	1,81 %	3,99 %	29,94 %	69,95 %
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (IH)	24.03.2023	EUR	1,60 %	3,75 %	–	–
FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	06.05.2011	USD	11,72 %	11,94 %	6,80 %	7,58 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M)	25.06.2010	USD	11,73 %	11,93 %	6,79 %	7,57 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	17.04.2020	SGD	4,65 %	5,44 %	2,18 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	21.03.2012	USD	11,14 %	11,36 %	5,17 %	2,29 %
	Klasse E USD Thesaurierend	17.02.2012	USD	11,04 %	11,25 %	4,88 %	1,29 %
	Klasse F USD Thesaurierend	22.07.2014	USD	12,15 %	12,37 %	8,05 %	11,93 %
	Klasse F USD Ausschüttend (M)	19.07.2013	USD	12,14 %	12,37 %	8,06 %	11,90 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert)	10.10.2014	GBP	11,79 %	11,97 %	5,74 %	-0,30 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	06.01.2012	USD	12,42 %	12,64 %	8,87 %	14,77 %
	Klasse Premier NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	19.09.2012	NZD	6,89 %	7,16 %	8,47 %	24,15 %
	Klasse LM NZD Thesaurierend (Abgesichert) (IH)	13.01.2012	NZD	7,57 %	7,85 %	10,52 %	32,27 %
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund	Klasse A USD Thesaurierend	30.08.2013	USD	7,07 %	8,51 %	18,05 %	44,90 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	26.08.2020	USD	7,07 %	8,52 %	18,05 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (D)	28.08.2020	USD	7,06 %	8,51 %	18,01 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	15.01.2021	USD	7,07 %	8,52 %	18,06 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	7,07 %	8,52 %	18,06 %	44,90 %
	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	23.06.2021	AUD	6,33 %	7,92 %	14,34 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	AUD	6,15 %	7,81 %	14,31 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	15.04.2021	CNH	4,11 %	5,81 %	8,78 %	–
	Klasse A CZK Thesaurierend (Abgesichert)	20.05.2022	CZK	5,84 %	7,26 %	17,61 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	25.11.2020	EUR	-5,95 %	-4,26 %	7,74 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	22.08.2016	EUR	4,72 %	6,16 %	11,01 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	19.05.2015	EUR	4,67 %	6,12 %	11,06 %	17,64 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert) (SH)	15.01.2025	EUR	3,52 %	–	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	15.01.2025	EUR	3,55 %	–	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	EUR	4,77 %	6,23 %	11,04 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	21.10.2013	EUR	4,78 %	6,27 %	11,12 %	17,63 %
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	30.08.2021	GBP	6,74 %	8,19 %	16,41 %	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	24.10.2013	GBP	6,73 %	8,16 %	16,41 %	31,79 %
	Klasse A HKD Thesaurierend	30.08.2021	HKD	7,69 %	8,74 %	17,68 %	–
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	09.04.2021	HKD	7,68 %	8,72 %	17,66 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	21.10.2015	SGD	4,28 %	5,99 %	11,41 %	30,98 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	17.02.2021	SGD	4,32 %	6,00 %	11,39 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) Plus	29.01.2021	SGD	0,19 %	2,11 %	13,10 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	23.09.2020	USD	6,54 %	7,97 %	16,31 %	–
	Klasse C USD Ausschüttend (D)	24.11.2020	USD	6,51 %	7,96 %	16,28 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	21.04.2020	USD	6,44 %	7,87 %	15,95 %	–
	Klasse E USD Ausschüttend (D)	22.01.2021	USD	6,36 %	7,79 %	15,88 %	–
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	03.04.2017	EUR	4,01 %	5,46 %	8,80 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	22.10.2020	USD	7,56 %	9,00 %	19,65 %	–
	Klasse F USD Ausschüttend (D)	24.07.2019	USD	7,51 %	8,94 %	19,55 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	25.09.2020	USD	7,76 %	9,23 %	20,37 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (D)	18.07.2017	USD	8,27 %	9,74 %	21,65 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund – (Fortsetzung)	Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	21.01.2014	USD	7,75 %	9,22 %	20,37 %	53,76 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	17.02.2021	EUR	-5,37 %	-3,70 %	9,56 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	16.02.2021	EUR	5,34 %	6,80 %	12,89 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	15.01.2025	EUR	4,49 %	–	–	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	23.12.2013	EUR	5,49 %	6,94 %	13,19 %	24,69 %
	Klasse X GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	20.12.2013	GBP	7,47 %	9,03 %	18,78 %	39,65 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	09.10.2020	USD	7,93 %	9,39 %	20,92 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	7,92 %	9,40 %	20,92 %	56,08 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	07.10.2014	EUR	5,50 %	6,95 %	13,56 %	26,63 %
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	15.01.2025	EUR	4,49 %	–	–	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	13.12.2013	EUR	5,37 %	6,90 %	13,60 %	26,35 %
	Klasse Premier SEK Thesaurierend (Abgesichert)	22.10.2014	SEK	5,32 %	6,70 %	13,33 %	26,27 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	06.07.2020	USD	8,03 %	9,50 %	21,27 %	–
	Klasse P2 USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	14.09.2021	USD	8,04 %	9,49 %	21,26 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	10.04.2018	EUR	5,73 %	7,23 %	14,09 %	–
	Klasse P2 EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	18.09.2018	EUR	5,58 %	7,07 %	14,09 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	01.02.2018	GBP	7,92 %	9,38 %	19,79 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	06.07.2022	USD	8,41 %	9,88 %	22,55 %	–
	Klasse LM USD Ausschüttend (M) Plus (e)	30.09.2021	USD	8,41 %	9,89 %	22,56 %	–
	Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (SH) Plus (e)	28.02.2024	USD	8,45 %	9,93 %	–	–
	Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	15.01.2025	EUR	4,81 %	–	–	–
	Klasse LM EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	11.08.2021	EUR	5,87 %	7,34 %	15,19 %	–
	Klasse LM GBP Thesaurierend (Abgesichert)	08.10.2020	GBP	8,07 %	9,52 %	20,89 %	–
FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	06.11.2023	USD	5,04 %	6,26 %	–	–
	Klasse P1 USD Thesaurierend	06.11.2023	USD	5,71 %	6,87 %	–	–
FTGF ClearBridge US Value Fund	Klasse A USD Thesaurierend	24.04.2007	USD	13,89 %	9,82 %	45,82 %	198,89 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	23.03.1998	USD	13,89 %	9,81 %	45,82 %	198,85 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.06.2007	EUR	0,03 %	-3,21 %	32,85 %	174,62 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.09.2022	EUR	11,76 %	7,69 %	37,32 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	02.09.2014	EUR	11,81 %	7,74 %	37,31 %	140,14 %
	Klasse A GBP ausschüttend (A)	28.08.2014	GBP	6,32 %	2,07 %	30,88 %	207,34 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	18.05.2007	SGD	6,56 %	3,29 %	39,84 %	168,23 %
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	10.09.2012	SGD	10,91 %	7,05 %	37,29 %	166,54 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	13,33 %	9,27 %	43,65 %	184,31 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	13,33 %	9,27 %	43,65 %	184,28 %
	Klasse E USD Thesaurierend	26.03.2021	USD	13,04 %	8,99 %	42,58 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	14,57 %	10,47 %	48,46 %	217,81 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	19.10.2016	USD	14,57 %	10,47 %	48,45 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	08.03.2022	USD	14,87 %	10,76 %	49,17 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	07.10.2013	USD	14,87 %	10,76 %	49,18 %	220,65 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	22.02.2021	EUR	0,85 %	-2,41 %	35,76 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	01.07.2008	USD	15,06 %	10,94 %	50,37 %	231,11 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	25.04.2014	USD	15,06 %	10,94 %	50,35 %	231,05 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	30.06.2014	EUR	1,01 %	-2,24 %	36,82 %	202,75 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	08.04.2021	EUR	12,85 %	8,73 %	41,58 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	21.12.2023	GBP	7,58 %	3,23 %	–	–
	Klasse S USD Thesaurierend	30.11.2023	USD	15,23 %	11,12 %	–	–
	LM Klasse USD Ausschüttend (A)	21.07.2021	USD	15,84 %	11,70 %	53,44 %	–
FTGF Putnam US Research Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	18,76 %	19,64 %	72,27 %	228,70 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	18,76 %	19,64 %	72,27 %	228,72 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	03.06.2008	EUR	4,20 %	5,42 %	56,92 %	202,54 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	18,06 %	18,99 %	69,72 %	212,59 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	18,06 %	18,99 %	69,72 %	212,60 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	17,77 %	18,69 %	68,43 %	204,85 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	21.01.2010	USD	17,77 %	18,69 %	68,42 %	204,77 %
	Klasse F USD Thesaurierend	17.09.2012	USD	19,24 %	20,17 %	75,08 %	248,17 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.02.2010	USD	19,24 %	20,18 %	75,09 %	248,17 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	07.10.2013	USD	19,75 %	20,63 %	76,04 %	251,00 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	07.10.2013	EUR	5,14 %	6,34 %	60,34 %	223,57 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	06.05.2010	USD	19,84 %	20,72 %	77,20 %	261,98 %

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Putnam US Research Fund – (Fortsetzung)	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	09.04.2009	USD	19,84 %	20,72 %	77,20 %	261,92 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	07.06.2010	EUR	5,43 %	6,61 %	61,77 %	233,86 %
	Klasse LM USD Thesaurierend	05.04.2016	USD	20,44 %	21,38 %	80,40 %	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	18,94 %	19,87 %	73,78 %	239,60 %
	Klasse B (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	18,35 %	19,28 %	71,16 %	222,38 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	18,35 %	19,28 %	71,19 %	223,03 %
	Klasse GA USD Thesaurierend	10.06.2011	USD	18,74 %	19,67 %	72,89 %	233,86 %
	Klasse GA EUR Thesaurierend	10.06.2011	EUR	4,25 %	5,48 %	57,52 %	207,45 %
	Klasse GA EUR Ausschüttend (A)	10.06.2011	EUR	4,25 %	5,48 %	57,48 %	207,47 %
	Klasse GE USD Thesaurierend	10.06.2011	USD	17,86 %	18,78 %	69,05 %	209,75 %
	Klasse GE EUR Thesaurierend	10.06.2011	EUR	3,46 %	4,69 %	54,01 %	185,19 %
FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund	Klasse A USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	1,93 %	6,25 %	90,34 %	249,71 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	1,93 %	6,25 %	90,34 %	249,77 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	27.08.2008	EUR	-10,54 %	-6,37 %	73,32 %	221,70 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	05.02.2016	EUR	0,16 %	4,32 %	79,75 %	182,05 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	20.11.2023	EUR	-10,59 %	-6,41 %	–	–
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	1,43 %	5,74 %	87,59 %	232,83 %
	Klasse B USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	1,43 %	5,72 %	87,51 %	232,66 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	1,43 %	5,72 %	87,51 %	232,67 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	20.04.2007	USD	1,43 %	5,72 %	87,51 %	232,66 %
	Klasse E USD Thesaurierend	14.01.2016	USD	1,17 %	5,46 %	86,11 %	224,46 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	13.10.2015	USD	1,16 %	5,45 %	86,11 %	224,43 %
	Klasse F USD Thesaurierend	19.04.2016	USD	2,54 %	6,89 %	93,79 %	–
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.11.2015	USD	2,54 %	6,89 %	93,78 %	271,35 %
	Klasse X USD Thesaurierend	29.09.2015	USD	2,63 %	6,98 %	94,09 %	272,57 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	17.01.2018	EUR	-9,95 %	-5,78 %	76,83 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	27.07.2016	EUR	0,83 %	5,06 %	83,49 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	04.12.2015	GBP	-4,30 %	-0,74 %	73,79 %	283,44 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	19.09.2014	USD	2,93 %	7,29 %	95,98 %	285,52 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	21.02.2020	USD	2,93 %	7,30 %	95,97 %	–
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	10,48 %	14,61 %	127,44 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	15.09.2016	EUR	-9,70 %	-5,50 %	78,35 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	02.03.2016	EUR	1,01 %	5,22 %	85,02 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (A)	21.02.2020	EUR	-9,69 %	-5,49 %	78,57 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	02.12.2015	GBP	-3,93 %	-0,37 %	75,72 %	296,61 %
	Klasse S USD Thesaurierend	02.03.2018	USD	3,03 %	7,40 %	96,56 %	–
	Klasse S USD Ausschüttend (Q)	14.12.2023	USD	3,03 %	7,40 %	–	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	02.03.2018	EUR	-9,60 %	-5,39 %	78,93 %	–
	Klasse LM USD Thesaurierend	05.04.2016	USD	3,57 %	7,97 %	99,68 %	–
	Klasse LM EUR Thesaurierend	04.10.2024	EUR	-9,05 %	-4,84 %	–	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	2,29 %	6,63 %	92,34 %	262,17 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	1,78 %	6,09 %	89,48 %	244,50 %
	Klasse GA USD Thesaurierend	27.08.2010	USD	2,11 %	6,44 %	91,36 %	256,06 %
	Klasse GA EUR Thesaurierend	27.08.2010	EUR	-10,35 %	-6,18 %	74,32 %	227,88 %
FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	13.08.2013	USD	8,48 %	3,69 %	38,86 %	123,12 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	8,47 %	3,69 %	38,86 %	123,23 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	19.06.2014	USD	8,48 %	3,68 %	38,85 %	123,11 %
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	03.06.2013	USD	8,52 %	3,71 %	38,81 %	123,09 %
	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	08.05.2015	USD	8,48 %	3,69 %	38,86 %	122,99 %
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	25.06.2014	AUD	7,06 %	2,37 %	32,63 %	97,49 %
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	28.07.2014	CNH	5,51 %	1,05 %	27,95 %	124,21 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	27.03.2015	EUR	-4,81 %	-8,62 %	26,48 %	105,27 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.11.2014	EUR	6,33 %	1,55 %	30,56 %	80,11 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	27.02.2014	EUR	6,34 %	1,55 %	30,55 %	80,11 %
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	28.07.2014	HKD	9,10 %	3,88 %	38,33 %	123,02 %
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	28.07.2014	SGD	5,67 %	1,00 %	30,61 %	99,44 %
	Klasse C USD Thesaurierend	27.09.2013	USD	8,06 %	3,29 %	37,02 %	112,62 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	27.03.2015	USD	8,06 %	3,28 %	37,02 %	112,63 %
	Klasse C USD Ausschüttend (Q)	29.08.2014	USD	8,06 %	3,28 %	37,03 %	112,58 %
	Klasse F USD Thesaurierend	27.03.2015	USD	9,13 %	4,31 %	41,37 %	136,92 %
	Klasse F EUR Thesaurierend	27.03.2015	EUR	-4,19 %	-8,05 %	28,77 %	118,33 %
	Klasse F EUR Ausschüttend (A)	27.03.2015	EUR	-4,19 %	-8,05 %	28,83 %	118,18 %
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus (e)	24.04.2017	EUR	7,17 %	2,36 %	33,34 %	–
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund	Klasse A USD Thesaurierend	11.03.2020	USD	11,16 %	8,83 %	41,85 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	11,15 %	8,83 %	41,85 %	227,68 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	28.02.2022	EUR	-2,43 %	-4,06 %	29,23 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.09.2015	EUR	8,98 %	6,66 %	33,49 %	163,85 %
	Klasse A SEK Thesaurierend	21.01.2020	SEK	-6,65 %	-9,29 %	25,75 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	11.03.2020	USD	11,82 %	9,48 %	44,43 %	–

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund – (Fortsetzung)	Klasse X USD Thesaurierend	30.07.2020	USD	11,93 %	9,59 %	44,63 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	11,93 %	9,59 %	44,63 %	248,48 %
	Klasse X EUR Thesaurierend	24.03.2021	EUR	-1,93 %	-3,59 %	31,53 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	30.09.2015	EUR	9,79 %	7,44 %	36,18 %	181,14 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	22.12.2015	GBP	4,38 %	1,68 %	29,42 %	258,84 %
	Klasse X GBP Thesaurierend (Abgesichert)	18.12.2019	GBP	11,71 %	9,34 %	42,34 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.06.2020	USD	12,21 %	9,87 %	45,94 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	30.09.2015	USD	12,21 %	9,87 %	45,94 %	260,52 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	27.05.2022	EUR	-1,31 %	-2,98 %	33,44 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	30.09.2015	GBP	4,64 %	1,97 %	30,63 %	269,98 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	11.07.2018	USD	12,44 %	10,09 %	46,82 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend	13.07.2020	EUR	-1,38 %	-3,06 %	33,58 %	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	13.07.2020	EUR	10,33 %	7,95 %	38,38 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend	31.07.2019	GBP	4,90 %	2,20 %	31,56 %	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	19.11.2019	GBP	12,23 %	9,86 %	44,49 %	–
	Klasse P2 GBP Ausschüttend (Q)	31.07.2019	GBP	4,90 %	2,20 %	31,59 %	–
	Klasse LM EUR Thesaurierend	21.05.2021	EUR	-0,90 %	-2,58 %	35,31 %	–
FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund	Klasse A USD Thesaurierend	29.06.2018	USD	11,97 %	16,36 %	67,10 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	06.12.2024	USD	11,55 %	15,95 %	–	–
	Klasse E USD Thesaurierend	06.12.2024	USD	11,28 %	15,70 %	–	–
	Klasse F USD Thesaurierend	06.12.2024	USD	12,75 %	17,23 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	29.06.2018	USD	13,11 %	17,54 %	72,20 %	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	06.12.2024	USD	13,54 %	18,01 %	–	–
FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	10.11.2017	USD	33,12 %	20,77 %	31,93 %	–
	Klasse A USD Thesaurierend (Abgesichert)	16.03.2017	USD	19,09 %	8,56 %	26,74 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	19.06.2017	USD	19,14 %	8,49 %	26,40 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	04.12.2023	USD	33,48 %	21,10 %	–	–
	Klasse A USD Ausschüttend (Q)	12.12.2016	USD	33,21 %	20,82 %	31,93 %	–
	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	24.10.2019	AUD	18,17 %	7,71 %	22,25 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	24.10.2019	CNH	16,01 %	5,88 %	17,06 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.12.2016	EUR	16,94 %	6,54 %	20,26 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	03.12.2019	EUR	23,13 %	12,26 %	23,42 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	26.04.2022	EUR	16,93 %	6,62 %	20,28 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) Plus	22.10.2018	EUR	17,01 %	6,55 %	20,33 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	05.06.2017	SGD	16,12 %	5,97 %	19,60 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend	26.09.2017	USD	32,45 %	20,20 %	30,15 %	–
	Klasse C USD Thesaurierend (Abgesichert)	26.09.2017	USD	18,56 %	8,07 %	24,70 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	12.12.2016	USD	32,25 %	19,99 %	29,20 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend (Abgesichert)	12.04.2021	USD	18,42 %	7,84 %	23,98 %	–
	Klasse E EUR Thesaurierend	06.04.2023	EUR	16,12 %	5,74 %	–	–
	Klasse E EUR Ausschüttend (A)	06.04.2023	EUR	16,17 %	5,76 %	–	–
	Klasse F USD Thesaurierend	10.08.2017	USD	33,96 %	21,55 %	34,55 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend (Abgesichert)	26.09.2017	USD	19,84 %	9,17 %	29,00 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	20.03.2019	USD	34,51 %	22,07 %	35,60 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	17.05.2017	USD	34,45 %	22,04 %	35,72 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	24.10.2018	EUR	18,06 %	7,54 %	23,62 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	05.03.2021	EUR	24,49 %	13,42 %	27,10 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (Q)	30.05.2019	GBP	25,42 %	13,22 %	21,47 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	04.02.2014	USD	34,48 %	22,11 %	36,35 %	156,03 %
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	30,26 %	18,34 %	53,94 %	–
	Klasse Premier CAD Ausschüttend (Q) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	16.06.2017	CAD	25,02 %	13,95 %	30,77 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	11.05.2012	EUR	18,30 %	7,73 %	24,30 %	137,03 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert) (PH)	17.04.2019	EUR	24,50 %	13,49 %	27,53 %	–
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	30.06.2016	GBP	25,74 %	13,52 %	22,29 %	–
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A) (Abgesichert) (PH) Plus (e)	25.06.2009	GBP	26,93 %	15,67 %	33,61 %	143,63 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (Q)	26.04.2018	GBP	25,68 %	13,45 %	22,22 %	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	30.06.2023	EUR	18,42 %	7,80 %	–	–
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund	Klasse A USD Thesaurierend	16.06.2021	USD	35,83 %	24,05 %	27,26 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus	30.04.2021	USD	35,82 %	24,04 %	27,24 %	–
	Klasse A USD Ausschüttend (M) Plus (e)	30.04.2021	USD	35,83 %	24,05 %	27,26 %	–

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund – (Fortsetzung)	Klasse A AUD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	12.08.2021	AUD	34,06 %	22,64 %	20,94 %	–
	Klasse A CNH Ausschüttend (M) (mit Absicherung) Plus	01.10.2021	CNH	32,12 %	20,90 %	16,82 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) Plus (e)	11.08.2022	EUR	19,36 %	9,42 %	16,09 %	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	11.08.2021	EUR	32,34 %	20,95 %	18,56 %	–
	Klasse A GBP Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	23.11.2021	GBP	35,02 %	23,33 %	24,37 %	–
	Klasse A HKD Ausschüttend (M) Plus	01.07.2021	HKD	36,62 %	24,31 %	26,87 %	–
	Klasse A SGD Ausschüttend (M) (Abgesichert) Plus	16.06.2021	SGD	32,05 %	20,78 %	19,04 %	–
	Klasse X USD Ausschüttend (M) Plus (e)	30.04.2021	USD	36,88 %	25,00 %	30,20 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	26.04.2022	EUR	33,31 %	21,78 %	21,19 %	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	30.04.2021	EUR	33,56 %	22,08 %	21,46 %	–
	Klasse X GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	12.01.2022	GBP	36,08 %	24,30 %	27,15 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	27.05.2022	USD	37,23 %	25,34 %	31,38 %	–
	Klasse Premier USD Ausschüttend (M) Plus	09.06.2021	USD	37,22 %	25,34 %	31,38 %	–
	Klasse Premier EUR Ausschüttend (M) (Abgesichert)	24.06.2021	EUR	33,89 %	22,21 %	22,48 %	–
	Klasse S USD Thesaurierend	27.01.2023	USD	37,44 %	25,52 %	–	–
	Klasse S USD Ausschüttend (Q) Plus (e)	13.09.2023	USD	37,42 %	25,51 %	–	–
	Klasse S EUR Thesaurierend	25.01.2023	EUR	20,67 %	10,68 %	–	–
	Klasse S EUR Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	11.04.2024	EUR	34,09 %	22,45 %	–	–
	Klasse S EUR Ausschüttend (Q) Plus (e)	11.12.2023	EUR	20,76 %	10,68 %	–	–
	Klasse S GBP Thesaurierend	26.01.2023	GBP	28,28 %	16,59 %	–	–
	Klasse S GBP Thesaurierend (Abgesichert)	08.03.2023	GBP	36,54 %	24,62 %	–	–
	Klasse S GBP Ausschüttend (Q) (Abgesichert) Plus (e)	23.08.2023	GBP	36,58 %	24,77 %	–	–
	Klasse S GBP Ausschüttend (Q) Plus (e)	28.04.2023	GBP	28,14 %	16,48 %	–	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	17.06.2021	USD	37,70 %	25,78 %	32,77 %	–
	Klasse P2 USD Ausschüttend (M) Plus	06.07.2021	USD	37,70 %	25,77 %	32,76 %	–
FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund^	Klasse A USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	23,91 %	22,36 %	–	–
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	SGD	20,31 %	19,01 %	–	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	25,15 %	23,60 %	–	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	22.09.2023	USD	25,58 %	24,02 %	–	–
	Klasse P2 EUR Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	EUR	22,87 %	21,30 %	–	–
	Klasse P2 GBP Thesaurierend (Abgesichert)	22.09.2023	GBP	25,04 %	23,35 %	–	–
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	30,08 %	11,06 %	43,69 %	255,88 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	08.11.2002	USD	30,08 %	11,06 %	43,69 %	255,87 %
	Klasse A AUD Thesaurierend (Abgesichert)	03.06.2013	AUD	27,97 %	9,24 %	35,73 %	199,91 %
	Klasse A CNH Thesaurierend (Abgesichert)	05.12.2016	CNH	26,37 %	8,12 %	32,24 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	12.07.2007	EUR	14,20 %	-2,12 %	30,75 %	226,69 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	20.02.2013	EUR	27,72 %	8,98 %	35,19 %	184,99 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A) (Abgesichert)	16.11.2016	EUR	27,74 %	9,07 %	35,22 %	–
	Klasse A GBP Thesaurierend (Abgesichert)	20.12.2013	GBP	29,66 %	10,69 %	40,92 %	204,98 %
	Klasse A GBP Ausschüttend (A)	26.04.2011	GBP	21,42 %	3,14 %	28,82 %	267,91 %
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SEK	27,13 %	8,45 %	33,76 %	168,98 %
	Klasse A SGD Thesaurierend	16.02.2011	SGD	21,59 %	4,43 %	37,52 %	217,89 %
	Klasse A SGD Thesaurierend (Abgesichert)	10.09.2012	SGD	26,52 %	8,17 %	34,76 %	213,51 %
	Klasse B USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	29,43 %	10,50 %	41,55 %	238,52 %
	Klasse B USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	29,43 %	10,50 %	41,55 %	238,22 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	29,43 %	10,51 %	41,55 %	238,52 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	24.02.2004	USD	29,43 %	10,50 %	41,55 %	238,52 %
	Klasse E USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	29,11 %	10,23 %	40,50 %	230,17 %
	Klasse E USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	29,11 %	10,23 %	40,49 %	230,14 %
	Klasse E EUR Thesaurierend	26.11.2010	EUR	13,37 %	-2,83 %	28,00 %	203,72 %
	Klasse E EUR Thesaurierend (Abgesichert)	23.09.2013	EUR	26,73 %	8,15 %	32,19 %	164,33 %
	Klasse F USD Thesaurierend	04.01.2011	USD	30,86 %	11,73 %	46,30 %	277,88 %

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Fonds	Anteilsklasse	Auflegungs- datum	Währung Klasse	Geschäftsjahr YTD 01.03.25-28.02.26	Kalenderjahr 01.01.25-31.12.25	3 Jahre kumulativ 01.01.23-31.12.25	Wertentwicklung 10 Jahre 01.03.16-28.02.26
FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund – (Fortsetzung)	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.01.2011	USD	30,86 %	11,73 %	46,29 %	277,89 %
	Klasse R EUR Thesaurierend	09.12.2013	EUR	14,76 %	-1,63 %	32,85 %	245,02 %
	Klasse X USD Thesaurierend	25.02.2013	USD	31,05 %	11,89 %	46,95 %	283,58 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	28.11.2016	USD	31,06 %	11,89 %	46,95 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	11.10.2017	EUR	15,05 %	-1,37 %	33,88 %	–
	Klasse X EUR Thesaurierend (Abgesichert)	21.10.2013	EUR	28,77 %	9,88 %	38,33 %	206,73 %
	Klasse X GBP Thesaurierend	18.01.2013	GBP	22,25 %	3,84 %	31,68 %	295,15 %
	Klasse X GBP ausschüttend (A)	23.04.2013	GBP	22,32 %	3,90 %	31,75 %	294,50 %
	Klasse Premier USD Thesaurierend	27.04.2010	USD	31,52 %	12,29 %	48,50 %	297,23 %
	Klasse Premier BRL Thesaurierend (Abgesichert)	15.02.2018	BRL	40,72 %	19,69 %	70,34 %	–
	Klasse Premier EUR Thesaurierend	07.06.2010	EUR	15,42 %	-1,07 %	35,20 %	264,37 %
	Klasse Premier EUR Thesaurierend (Abgesichert)	31.08.2015	EUR	29,06 %	10,11 %	39,66 %	218,47 %
	Klasse Premier GBP Thesaurierend	15.02.2013	GBP	22,66 %	4,23 %	33,08 %	308,93 %
	Klasse Premier PLN Thesaurierend (Abgesichert)	03.08.2018	PLN	31,91 %	12,71 %	50,44 %	–
FTGF Royce US Smaller Companies Fund	Klasse A USD Thesaurierend	09.05.2007	USD	24,41 %	3,47 %	26,46 %	158,01 %
	Klasse A USD Ausschüttend (A)	01.03.2004	USD	24,34 %	3,41 %	26,29 %	157,39 %
	Klasse A EUR Thesaurierend	01.10.2008	EUR	9,18 %	-8,83 %	15,00 %	136,34 %
	Klasse A EUR Thesaurierend (Abgesichert)	05.06.2013	EUR	22,27 %	1,55 %	19,06 %	106,64 %
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	09.02.2011	EUR	9,17 %	-8,86 %	14,94 %	135,11 %
	Klasse A SEK Thesaurierend (Abgesichert)	31.01.2013	SEK	22,50 %	1,72 %	18,53 %	98,51 %
	Klasse C USD Thesaurierend	15.11.2007	USD	23,78 %	2,95 %	24,58 %	145,36 %
	Klasse C USD Ausschüttend (A)	01.03.2004	USD	23,73 %	2,89 %	24,41 %	144,83 %
	Klasse E USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	23,41 %	2,64 %	23,49 %	138,79 %
	Klasse E EUR Thesaurierend	14.01.2019	EUR	8,38 %	-9,51 %	12,38 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	21.01.2010	USD	25,09 %	4,03 %	28,58 %	173,29 %
	Klasse F USD Ausschüttend (A)	04.02.2010	USD	25,09 %	4,03 %	28,58 %	173,31 %
	Klasse X USD Ausschüttend (A)	15.04.2021	USD	25,27 %	4,18 %	29,44 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	24.11.2009	USD	25,71 %	4,54 %	30,51 %	187,22 %
	Klasse Premier USD Ausschüttend (A)	18.02.2011	USD	25,72 %	4,56 %	30,52 %	187,29 %
	Klasse Premier GBP Ausschüttend (A)	20.05.2011	GBP	17,33 %	-2,90 %	16,97 %	196,27 %
	Klasse P2 USD Thesaurierend	15.07.2024	USD	26,30 %	5,09 %	–	–
	Klasse A (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	25,09 %	4,03 %	28,58 %	173,30 %
	Klasse L (G) USD Thesaurierend	20.04.2007	USD	24,47 %	3,51 %	26,67 %	159,97 %
FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	17,98 %	7,87 %	15,62 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	19,08 %	8,88 %	18,57 %	–
	Klasse X GBP Thesaurierend	11.08.2022	GBP	11,33 %	1,21 %	6,19 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	01.12.2021	USD	19,30 %	9,07 %	19,50 %	–
FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund [^]	Klasse A USD Thesaurierend	24.11.2017	USD	49,78 %	33,75 %	40,59 %	–
	Klasse E USD Thesaurierend	10.09.2018	USD	48,69 %	32,76 %	37,45 %	–
	Klasse F USD Thesaurierend	13.11.2018	USD	50,70 %	34,57 %	43,14 %	–
	Klasse X USD Thesaurierend	13.12.2017	USD	50,92 %	34,76 %	43,67 %	–
	Klasse Premier USD Thesaurierend	13.12.2017	USD	51,45 %	35,24 %	45,29 %	–
	Klasse P2 USD Thesaurierend	29.10.2018	USD	51,74 %	35,50 %	46,14 %	–
Franklin Responsible Income 2028 Fund [^]	Klasse P2 EUR Thesaurierend	16.01.2018	EUR	33,03 %	19,27 %	32,94 %	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	2,58 %	2,98 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	2,58 %	2,98 %	–	–
	Klasse D EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	2,02 %	2,42 %	–	–
	Klasse D EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	2,02 %	2,42 %	–	–
	Klasse X EUR Thesaurierend	23.01.2023	EUR	2,99 %	3,40 %	–	–
Franklin Responsible Income 2029 Fund [^]	Klasse X EUR Ausschüttend (A)	23.01.2023	EUR	2,99 %	3,39 %	–	–
	Klasse A EUR Thesaurierend	27.03.2024	EUR	2,91 %	3,19 %	–	–
	Klasse A EUR Ausschüttend (A)	27.03.2024	EUR	2,91 %	3,19 %	–	–
	Klasse X EUR Ausschüttend (A)	27.03.2024	EUR	3,32 %	3,61 %	–	–

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

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

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Wesentliche Veränderungen in der Zusammensetzung des Wertpapierbestands (ungeprüft)

Für das Geschäftsjahr zum 28. Februar 2026

Gemäß den OGAW-Verordnungen wird eine Aufstellung über die wichtigsten Veränderungen in der Zusammensetzung des Anlageportfolios jedes Fonds während des Berichtszeitraums vorgelegt, um zu gewährleisten, dass die Anteilsinhaber die Veränderungen in den Anlagen der einzelnen Fonds erkennen können. Diese sind definiert als die Gesamtkäufe und -verkäufe einer Anlage (einschließlich Fälligkeiten, aber ohne Finanzderivate), die 1,00 % des Gesamtwerts der Käufe und Verkäufe während des Geschäftsjahrs überschreiten. Es werden mindestens die zwanzig größten Käufe und die zwanzig größten Verkäufe aufgeführt. Sollte ein Fonds während des Geschäftsjahrs weniger als zwanzig Käufe oder Verkäufe getätigt haben, sind alle Transaktionen aufgeführt.

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 09.01.2026	193.483	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 09.01.2026	193.483
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 12.01.2026	190.000	JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 12.01.2026	190.000
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,120 %, fällig 21.10.2025	184.392	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,120 %, fällig 21.10.2025	184.392
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,900 %, fällig 10.12.2025	183.647	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,900 %, fällig 10.12.2025	183.647
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,120 %, fällig 25.09.2025	180.948	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,120 %, fällig 25.09.2025	180.948
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,150 %, fällig 20.10.2025	180.738	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,150 %, fällig 20.10.2025	180.738
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 12.01.2026	178.701	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 12.01.2026	178.701
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,090 %, fällig 24.09.2025	178.525	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,090 %, fällig 24.09.2025	178.525
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,900 %, fällig 19.11.2025	177.939	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,900 %, fällig 19.11.2025	177.939
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 04.02.2026	176.195	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 04.02.2026	176.195
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,970 %, fällig 14.11.2025	176.154	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,970 %, fällig 14.11.2025	176.154
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 06.01.2026	175.777	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 06.01.2026	175.777
TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,110 %, fällig 23.09.2025	175.360	TD Securities USA, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 4,110 %, fällig 23.09.2025	175.360
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,620 %, fällig 08.01.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,630 %, fällig 06.02.2026	175.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 02.03.2026	175.000	JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 15.01.2026	175.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,640 %, fällig 26.02.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,620 %, fällig 11.02.2026	175.000
JP Morgan Securities, LLC, Reverse Repurchase Agreement, 3,710 %, fällig 19.02.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,620 %, fällig 10.02.2026	175.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,620 %, fällig 15.01.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,620 %, fällig 14.01.2026	175.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,660 %, fällig 03.02.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,670 %, fällig 18.02.2026	175.000
Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,630 %, fällig 29.01.2026	175.000	Canadian Imperial Bank of Commerce, Reverse Repurchase Agreement, 3,610 %, fällig 09.01.2026	175.000

FTGF Western Asset US Core Bond Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	30.059	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	31.460
United States Treasury Note/Bond, 3,375 %, fällig 31.12.2027	3.049	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	1.450
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.179	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	1.303
Mexiko, Internationale Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 12.02.2034	994	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.183
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	871	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,875 %, fällig 15.07.2034	927
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	849	Fannie Mae Pool 'F55313', 3,500 %, fällig 01.01.2050	902
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	821	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	901
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	800	BHMS 2018-ATLS 144A, 5,889 %, fällig 15.07.2035	873
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	799	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	873
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	796	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	858
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	791	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	819
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	791	CSMC 2018-J1 Trust 144A, 3,578 %, fällig 25.02.2048	814
Fannie Mae Pool 'CB9635', 4,500 %, fällig 01.12.2054	783	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,000 %	807
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	770	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	799
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	767	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	797
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	705	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	797
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	701	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	797
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	701	Fannie Mae Pool 'CB9635', 4,500 %, fällig 01.12.2054	780
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	690	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	776
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	687	Fannie Mae Pool 'BX8180', 5,500 %, fällig 01.04.2053	774

FTGF Western Asset US Core Plus Bond Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.08.2025	11.353	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.08.2025	11.389
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.10.2025	10.254	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.10.2025	10.390
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.05.2025	9.917	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	10.114
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 02.10.2025	9.779	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 29.05.2025	9.944
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.604	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 02.10.2025	9.809
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	8.387	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	9.633
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.378	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	8.441
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.224	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.315
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.876	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	8.233
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.849	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.915

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

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

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.619	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.890
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.765	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	7.611
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.145	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.779
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.037	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.133
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.019	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	6.029
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.962	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.975
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.489	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.971
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.335	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.476
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.899	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.327
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.851	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	5.106
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	4.843		
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	4.753		
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 28.02.2030	4.655		

FTGF Western Asset Global Multi Strategy Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 20.11.2025	16.117	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	24.374
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.03.2030	12.363	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 20.11.2025	16.193
United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	10.916	United States Treasury Note/Bond, 0,375 %, fällig 31.01.2026	10.922
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	9.197	United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 31.10.2027	10.496
United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	8.839	United States Treasury Note/Bond, 0,750 %, fällig 30.04.2026	8.845
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.09.2030	8.370	United States Treasury Note/Bond, 2,000 %, fällig 15.11.2026	7.688
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	5.075	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	6.002
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 30.04.2029	3.693	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.03.2028	5.567
Republik Südafrika, Staatsanleihe, Serie 2030, 8,000 %, fällig 31.01.2030	1.783	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.03.2030	4.889
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 1,700 %, fällig 15.08.2032	1.752	United States Treasury Note/Bond, 3,125 %, fällig 15.05.2048	4.094
Lineage Europe Finco BV REGs, 4,125 %, fällig 26.11.2031	1.546	Franklin Templeton Qualified Investor Funds (II) Plc – Western Asset India	
Goldman Sachs Group Inc/The, 5,387 %, fällig 02.02.2041	1.380	Bond Fund – Klasse LM USD Thesaurierend	3.307
P3 Group Sarl, 3,375 %, fällig 22.03.2031	1.373	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR59, 7,000 %, fällig am 15.05.2027	2.458
Deutsche Bank AG, 7,125 %, Ewige Anleihe	1.296	United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 15.11.2042	2.150
CTP NV, 3,625 %, fällig 10.03.2031	1.241	United States Treasury Note/Bond, 0,625 %, fällig 31.03.2027	2.140
T-Mobile USA Inc, 5,125 %, fällig 15.05.2032	1.089	Republik Polen, Staatsanleihe, Serie 0432, 1,750 %, fällig 25.04.2032	1.914
Iberdrola Finanzas SA, 3,750 %, Ewige Anleihe	1.044	Staatsanleihe Republik Südafrika, Serie R214, 6,500 %, fällig 28.02.2041	1.798
Canal+ SA, 4,625 %, fällig 03.12.2030	1.043	BNP Paribas SA REGs, 7,375 %, Ewige Anleihe	1.690
Nationwide Building Society, 7,875 %, Ewige Anleihe	1.041	United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.08.2043	1.640
NatWest Group Plc, 7,625 %, Ewige Anleihe	1.001	Gatwick Airport Finance Plc, 4,375 %, fällig am 07.04.2026	1.520
		United States Treasury Note/Bond, 4,125 %, fällig 15.11.2032	1.513

FTGF Western Asset US High Yield Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	42.258	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	41.160
Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	964	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,750 %, fällig 01.02.2032	966
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,375 %, fällig 01.02.2036	799	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 6,000 %, fällig 01.02.2033	938
Michaels Cos Inc/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.03.2034	726	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	886
Altice France Lux 3 / Altice Holdings 1, 144A, 10,000 %, fällig 15.01.2033	705	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	829
Rent-A-Center, 6,634 %, fällig 19.08.2032	643	WW International Inc 144A, 0,000 %, fällig 15.04.2029	808
AECOM, 144A, 6,000 %, fällig 01.08.2033	626	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 9,375 %, fällig 01.03.2029	766
WW International Inc	608	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	746
Altice France SA, 144A, 6,500 %, fällig 15.04.2032	603	Altice France Holding SA, 144A, 10,500 %, fällig 15.05.2027	705
Flutter Treasury DAC, 144A, 5,875 %, fällig 04.06.2031	602	Intesa Sanpaolo SpA, 144A, 5,710 %, fällig 15.01.2026	702
TopBuild Corp, 144A, 5,625 %, fällig 31.01.2034	582	NCL Corp Ltd, 144A, 7,750 %, fällig 15.02.2029	689
NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	580	Viasat Inc, 144A, 7,500 %, fällig 30.05.2031	669
Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2033	573	Venture Global Calcasieu Pass LLC 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2030	666
Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032	540	Upbound Group Inc, 0,000 %, fällig 17.02.2028	646
Crescent Energy Finance LLC, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2034	520	Altice France SA, 144A, 5,125 %, fällig 15.07.2029	603
Akumin Inc, 144A, 9,750 %, fällig 31.08.2031	514	Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 9,250 %, fällig 01.07.2031	573
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2033	510	NCL Corp Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 15.01.2029	545
Carnival Corp, 144A, 5,875 %, fällig 15.06.2031	510	CommScope LLC, 144A, 4,750 %, fällig 01.09.2029	528
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,000 %, Ewige Anleihe	466	Akumin Inc, 144A, 9,000 %, fällig 01.08.2027	514
Axon Enterprise Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.03.2033	461	Level 3 Financing Inc 144A, 11,000 %, fällig 15.11.2029	505

FTGF Western Asset Global High Yield Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Altice France Lux 3 / Altice Holdings 1, 144A, 10,000 %, fällig 15.01.2033	394	Türkei, Internationale Staatsanleihe, Series 11Y, 4,250 %, fällig 14.04.2026	560
Altice France SA, 144A, 6,875 %, fällig 15.07.2032	375	Panama Government International Bond, 2,252 %, fällig 29.09.2032	491
Michaels Cos Inc/The, 144A, 11,000 %, fällig 15.03.2034	348	Royal Caribbean Cruises Ltd, 144A, 5,500 %, fällig 01.04.2028	451
Provincia de Cordoba, 144A, 9,750 %, fällig 02.07.2032	340	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.02.2029	416
NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	310	Altice France SA, 144A, 5,000 %, fällig 15.02.2028	394
Vmed O2 UK Financing I Plc, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2033	270	Altice France SA, 144A, 5,500 %, fällig 15.10.2029	375
Asurion LLC and Asurion Co-Issuer Inc, 144A, 8,000 %, fällig 31.12.2032	260	Nigeria, Internationale Staatsanleihe, 144A, 7,143 %, fällig 23.02.2030	344
SV RNO Property Owner 1 LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.03.2031	260	Provincia de Cordoba Step-Up Coupon 144A, 6,990 %, fällig 01.06.2027	338
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,875 %, fällig 01.02.2032	260	NCL Corp Ltd, 144A, 6,750 %, fällig 01.02.2032	327
Crescent Energy Finance LLC, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2034	250	Provincia de Buenos Aires/Staatsanleihen, 144A, 6,625 %, fällig 01.09.2037	309
ZF North America Capital Inc, 144A, 6,750 %, fällig 23.04.2030	238	Expand Energy Corp, 4,750 %, fällig 01.02.2032	307
Tenet Healthcare Corp, 144A, 6,000 %, fällig 15.11.2033	230	Ägypten, Internationale Staatsanleihe, REGs, 6,588 %, fällig 21.02.2028	294
Granite Ridge Resources Inc, 144A, 8,875 %, fällig 05.11.2029	221	Cidron Aida Finco Sarl REGs, 6,250 %, fällig 01.04.2028	285

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

FTGF Western Asset Global High Yield Fund – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Grupo Nutresa SA, 144A, 8,000 %, fällig 12.05.2030	212	AerCap Ireland Capital DAC / AerCap Global Aviation Trust, 3,400 %, fällig 29.10.2033	282
AES Andes SA, 144A, 6,250 %, fällig 14.03.2032	205	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC / Ardagh Metal Packaging Finance Plc, 144A, 6,000 %, fällig 15.06.2027	280
WW International Inc, 10,489 %, fällig 24.06.2030	204	888 Acquisitions Ltd REGS, 7,558 %, fällig 15.07.2027	259
CoreWeave Inc, 144A, 9,250 %, fällig 01.06.2030	203	ZF North America Capital Inc, 144A, 6,875 %, fällig 14.04.2028	252
VZ Secured Financing BV, 144A, 7,500 %, fällig 15.01.2033	202	Magnetite XII Ltd 144A, 10,198 %, fällig 15.10.2031	250
Burford Capital Global Finance LLC, 144A, 7,500 %, fällig 15.07.2033	200	T-Mobile USA Inc, 2,625 %, fällig 15.04.2026	245
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 6,375 %, fällig 15.02.2036	200	American Airlines Inc, 144A, 8,500 %, fällig 15.05.2029	240

FTGF Western Asset Asian Opportunities Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	55.188	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	59.974
Singapur, Staatsanleihe, 2,375 %, fällig 01.07.2039	11.708	Singapur, Staatsanleihe, 2,375 %, fällig 01.07.2039	10.452
Indonesien, Schatzanleihe, Serie FR98, 7,125 %, fällig 15.06.2038	5.671	Indonesische Staatsanleihe, Serie FR89, 6,875 %, fällig am 15.08.2051	9.541
Indonesia Treasury Bond, Series 104, 6,500 %, fällig 15.07.2030	3.837	Malaysia, Staatsanleihe, 3,899 %, fällig 16.11.2027	8.795
Singapur, Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.03.2035	3.510	Korea, Schatzanleihe, Serie 3206, 3,375 %, fällig 10.06.2032	5.709
European Bank for Reconstruction & Development, 6,300 %, fällig 26.10.2027	2.314	Singapur, Staatsanleihe, 2,625 %, fällig 01.08.2032	5.124
Public Utilities Board, 2,486 %, fällig 15.10.2055	2.123	Thailändische Staatsanleihe, 2,050 %, fällig 17.04.2028	5.087
Hongkong, Internationale Staatsanleihe, 3,850 %, fällig 10.06.2055	2.049	Malaysia, Staatsanleihe, Serie 0122, 3,582 %, fällig 15.07.2032	5.042
Housing & Development Board, 2,471 %, fällig 21.01.2036	1.746	Singapur, Staatsanleihe, 3,000 %, fällig 01.08.2072	5.011
Housing & Development Board, 2,315 %, fällig 18.09.2034	1.589	Chinesische Staatsanleihe, Serie INBK, 3,120 %, fällig 25.10.2052	4.746
Netlink Treasury Pte Ltd, 2,650 %, fällig am 03.09.2035	1.556	Agricultural Development Bank of China, Serie 1806, 4,650 %, fällig 11.05.2028	3.737
Malaysia, Staatsanleihe, Serie 0120, 4,065 %, fällig 15.06.2050	1.309	Singapur, Staatsanleihe, 2,750 %, fällig 01.03.2035	3.667
Singapur, Staatsanleihe, 2,250 %, fällig 01.07.2040	1.173	Internationale Anleihe der philippinischen Regierung, 6,250 %, fällig 14.01.2036	3.566
Indien, Staatsanleihe, 7,240 %, fällig 18.08.2055	1.135	Chinesische Staatsanleihe, 3,600 %, fällig 21.05.2030	3.468
Asian Development Bank, 6,200 %, fällig 06.10.2026	1.101	Indien, Staatsanleihe, 7,260 %, fällig 22.08.2032	3.460
Indien, Staatsanleihe, 6,220 %, fällig 16.03.2035	1.097	Thailändische Staatsanleihe, 3,300 %, fällig 17.06.2038	3.382
Korea Gas Corp REGS, 4,250 %, fällig 10.07.2030	997	Korea, Schatzanleihe, Serie 3909, 1,125 %, fällig 10.09.2039	2.816
Indien, Staatsanleihe, 6,100 %, fällig 12.07.2031	557	Indonesien, Schatzanleihe, Serie FR98, 7,125 %, fällig 15.06.2038	2.803
Housing & Development Board, 2,699 %, fällig 09.10.2034	411	Indische Staatsanleihe, 7,170 %, fällig 08.01.2028	2.565
Indien, Staatsanleihe, 5,770 %, fällig 03.08.2030	220	Indien, Staatsanleihe, 7,180 %, fällig 24.07.2037	2.546
		Indien, Staatsanleihe, 7,610 %, fällig 09.05.2030	2.421
		Korea, Schatzanleihe, Series 3006, 1,375 %, fällig 10.06.2030	1.832
		Banco Santander SA, 3,600 %, fällig 23.10.2030	1.817

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	70.892	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	72.766
Toronto-Dominion Bank/The, 3,357 %, fällig 22.09.2032	3.724	Rio Tinto Finance USA Plc, 5,000 %, fällig 14.03.2032	3.098
Rio Tinto Finance USA Plc, 5,000 %, fällig 14.03.2032	2.981	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.08.2032	2.754
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.08.2032	2.773	Blackstone Holdings Finance Co LLC REGS, 1,000 %, fällig 05.10.2026	2.682
Bank of Montreal, 4,875 %, fällig 01.10.2031	2.369	Schneider Electric SE EMTN, 3,125 %, fällig 13.10.2029	2.631
Novo Nordisk Finance Netherlands BV, 2,875 %, fällig 27.08.2030	2.286	Athene Global Funding, 3,410 %, fällig 25.02.2030	2.603
adidas AG, 2,750 %, fällig 06.11.2030	2.195	Toronto-Dominion Bank/The EMTN, 2,875 %, fällig 05.04.2027	2.488
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	2.014	Microsoft Corp, 2,400 %, fällig 08.08.2026	2.361
UBS Group AG, 3,125 %, fällig 13.02.2031	1.959	Vattenfall AB EMTN, 3,750 %, fällig 18.10.2026	2.317
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2030	1.851	TenneT Holding BV, 1,625 %, fällig 17.11.2026	2.267
Linde Plc, 3,125 %, fällig 20.11.2032	1.848	UBS Group AG, 4,703 %, fällig 05.08.2027	2.158
Colgate-Palmolive Co, 3,250 %, fällig 10.11.2035	1.825	Aeroports de Paris SA EMTN, 3,375 %, fällig 16.05.2031	2.138
Meta Platforms Inc, 4,600 %, fällig 15.11.2032	1.800	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	2.102
Honeywell International Inc, 3,750 %, fällig 17.05.2032	1.740	Pfizer Investment Enterprises Pte Ltd, 4,650 %, fällig 19.05.2030	2.048
Visa Inc, 3,125 %, fällig 15.05.2033	1.699	Experian Finance Plc, 0,739 %, fällig 29.10.2025	1.938
L'Oreal SA, 2,750 %, fällig 19.11.2030	1.622	Alphabet Inc, 0,800 %, fällig 15.08.2027	1.921
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	1.536	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2030	1.850
Enxsis Holding NV, 3,000 %, fällig 25.02.2032	1.466	Gilead Sciences Inc, 3,650 %, fällig 01.03.2026	1.820
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2034	1.461	ABB Finance BV, 3,250 %, fällig 16.01.2027	1.729
Comcast Corp, 3,250 %, fällig 26.09.2032	1.406	Alliander NV, 2,625 %, fällig 09.09.2027	1.714
Lloyds Banking Group Plc, 4,425 %, fällig 04.11.2031	1.400	Adobe Inc, 2,150 %, fällig 01.02.2027	1.674
		Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2030	1.579
		Motability Operations Group PLC EMTN, 0,125 %, fällig 20.07.2028	1.553
		Prologis International Funding II SA, 1,750 %, fällig 15.03.2028	1.524
		Nestle Holdings Inc, 5,250 %, fällig 13.03.2026	1.508

FTGF Western Asset Global Bond Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.233	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,250 %, fällig 15.08.2028	3.466
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.01.2031	2.923	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	3.259
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2027	2.878	Australien, Staatsanleihe, 3,750 %, fällig 21.05.2034	2.932
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.800	Deutsche Bundesrepublik Inflationsindexierte Anleihe, Serie iL, 0,500 %, fällig 15.04.2030	2.867
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.06.2025	2.792	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 24.06.2025	2.810
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.682	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.804
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	2.595	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.678
Korea, Schatzanleihe, Serie 3506, 2,625 %, fällig 10.06.2035	2.561	United States Treasury Note/Bond, 4,500 %, fällig 31.05.2029	2.660

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

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

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.560	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.567
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.556	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.549
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.346	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	2.425
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.338	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 2,500 %	2.366
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.159	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.343
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.150	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 30.06.2030	2.295
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.145	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	2.159
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.124	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.08.2027	2.150
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.10.2030	2.028	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.145
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 19.02.2026	1.933	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.141
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.922	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	2.128
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	1.905	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 1,125 %, fällig 15.10.2030	2.035

FTGF Western Asset Global Credit Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	11.269	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	12.579
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.06.2025	1.299	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 03.06.2025	1.299
BPCE SA 144A, 6,293 %, fällig 14.01.2036	529	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032	681
Anglo American Capital Plc, 144A, 5,500 %, fällig 02.05.2033	411	JPMorgan Chase & Co, 0,389 %, fällig 24.02.2028	552
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2034	394	BPCE SA 144A, 6,293 %, fällig 14.01.2036	528
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15.02.2035	387	Lloyds Banking Group PLC EMTN, 3,625 %, fällig 04.03.2036	430
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2028	371	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,600 %, fällig 15.08.2034	424
Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	355	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,500 %, fällig 15.02.2035	403
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	330	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,500 %, fällig 15.02.2028	373
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series TWIN, 0,000 %, fällig 15.08.2031	309	Bundesrepublik Deutschland, Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2031	364
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 0,000 %, fällig 15.02.2032	288	NatWest Group Plc, 4,500 %, Ewige Anleihe	352
United States Treasury Note/Bond, 4,375 %, fällig 15.05.2034	267	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.11.2043	326
Credit Agricole SA 144A, 5,862 %, fällig 09.01.2036	256	Bank of America Corp EMTN, 1,662 %, fällig 25.04.2028	318
Heineken NV, 3,276 %, fällig 29.10.2032	255	UBS Group AG, 3,250 %, fällig 12.02.2034	301
Banco Santander SA, 7,000 %, Ewige Anleihe	252	Morgan Stanley, 4,656 %, fällig 02.03.2029	280
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, 2,200 %, fällig 15.02.2034	249	Whitbread Group Plc, 5,500 %, fällig 31.05.2032	269
Barclays Plc, 6,125 %, Ewige Anleihe	231	Netflix Inc, 3,625 %, fällig 15.06.2030	262
Deutsche Bank AG, 6,750 %, Ewige Anleihe	231	J Sainsbury PLC EMTN, 5,625 %, fällig 29.01.2035	261
American Express Co, 3,433 %, fällig 20.05.2032	230	McDonald's Corp, 5,450 %, fällig 14.08.2053	258
Alphabet Inc, 3,875 %, fällig 06.05.2045	230	Banco Santander SA, 7,000 %, Ewige Anleihe	258

FTGF Western Asset Multi-Asset Credit Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.07.2025	24.994	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.07.2025	25.000
CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	2.252	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 4,250 %, fällig 01.02.2031	2.139
Venture Global Plaquemines LNG LLC, 144A, 6,750 %, fällig 15.01.2036	2.243	Credit Agricole SA, 144A, 8,125 %, ohne Laufzeitbegrenzung	1.851
First Quantum Minerals Ltd, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2034	2.042	Harriman Park CLO LTD 144A, 10,931 %, fällig 20.04.2034	1.700
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 144A, 7,000 %, fällig 01.02.2033	1.788	Cooperative Rabobank UA, 4,625 %, Ewige Anleihe	1.648
Venture Global LNG Inc, 144A, 9,500 %, fällig 01.02.2029	1.623	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	1.629
Crescent Energy Finance LLC, 144A, 7,375 %, fällig 15.01.2033	1.515	GFL Environmental Inc, 144A, 4,750 %, fällig 15.06.2029	1.614
NRG Energy Inc, 144A, 6,000 %, fällig 15.01.2036	1.460	Rocket Mortgage LLC / Rocket Mortgage Co-Issuer Inc 144A, 3,625 %, fällig 01.03.2029	1.584
Greystone CRE Notes 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,141 %, fällig 15.01.2043	1.347	Medline Borrower LP, 144A, 5,250 %, fällig 01.10.2029	1.572
Vantage Data Centers LLC, Series 2020 2A, Class A2, 144A, 1,992 %, fällig 15.09.2045	1.295	CommScope Technologies LLC, 144A, 5,000 %, fällig 15.03.2027	1.481
PPM CLO 8 Ltd, Series 2025 8A, Class D1, 144A, 6,668 %, fällig 20.04.2038	1.234	CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 10,875 %, fällig 15.01.2032	1.398
CHS/Community Health Systems Inc, 144A, 9,750 %, fällig 15.01.2034	1.233	Clear Channel Outdoor Holdings Inc 144A, 5,125 %, fällig 15.08.2027	1.394
GS Mortgage Securities Trust 2014-GC24, Series 2014 GC24, Class B, 4,498 %, fällig 10.09.2047	1.233	Ballyrock CLO 19 Ltd 144A, 11,382 %, fällig 20.04.2035	1.351
Spirit Loyalty Cayman Ltd / Spirit IP Cayman Ltd, 144A, 11,000 %, fällig 12.03.2030	1.214	McLaren Finance PLC 144A, 7,500 %, fällig 01.08.2026	1.337
BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class D, 144A, 6,117 %, fällig 15.02.2042	1.200	Nexstar Media Inc 144A, 5,625 %, fällig 15.07.2027	1.328
PBF Holding Co LLC / PBF Finance Corp, 6,000 %, fällig 15.02.2028	1.197	CSC Holdings LLC, 144A, 11,750 %, fällig 31.01.2029	1.318
STWD 2025-FL4 LLC, Series 2025 FL4, Class A, 144A, 5,116 %, fällig 19.11.2042	1.150	Vantage Data Centers LLC, Series 2020 2A, Class A2, 144A, 1,992 %, fällig 15.09.2045	1.309
Freddie Mac Mscr Trust Mn2, Series 2021 MN2, Class M2, 144A, 7,017 %, fällig 25.07.2041	1.135	CSC Holdings LLC 144A, 5,500 %, fällig 15.04.2027	1.296
Railworks Holdings LP / Railworks Rally Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.11.2028	1.127	Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	1.293
Global Auto Holdings Ltd/AAG FH UK Ltd, 144A, 8,375 %, fällig 15.01.2029	1.120	Marble Point CLO XIV Ltd, Series 2018 2A, Class D, 144A, 8,117 %, fällig 20.01.2032	1.270

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	218.593	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	203.247
Verus Securitization Trust 2025-4, Series 2025 4, Class A3, 144A, 5,753 %, fällig 25.05.2070	7.650	Freddie Mac REMICS 5482, Class FC, 4,967 %, fällig 25.12.2054	19.962
BRAVO Residential Funding Trust 2025-NQM7, Series 2025 NQM7, Class A3, 144A, 5,814 %, fällig 25.07.2065	5.290	Freddie Mac REMICS 5483, Class FD, 5,648 %, fällig 25.12.2054	19.486
		GS Mortgage Securities Corp Trust 2018-SRP5 144A, 10,876 %, fällig 15.09.2031	6.893

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Western Asset Structured Opportunities Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Verus Securitization Trust 2025-R1, Series 2025 R1, Class A3, 144A, 5,774 %, fällig 25.05.2065	5.280	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Serie 2021 R01, Klasse 1B2, 144A, 10,348 %, fällig 25.10.2041	5.913
BX Commercial Mortgage Trust 2026-CSMO, Series 2026 CSMO, Class D, 144A, 6,117 %, fällig 15.02.2042	5.260	Connecticut Avenue Securities Trust 2021-R01, Series 2021 R01, Class 1B1, 144A, 6,767 %, fällig 25.10.2041	5.893
OBX 2025-NQM8 Trust, Series 2025 NQM8, Class A3, 144A, 5,826 %, fällig 25.03.2065	5.160	Freddie Mac STACR Trust 2018-DNA3, Series 2018 DNA3, Class B2, 144A, 12,213 %, fällig 25.09.2048	5.738
OBX 2025-NQM10 Trust, Series 2025 NQM10, Class A3, 144A, 5,706 %, fällig 25.05.2065	4.390	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2025-DNA1, Series 2025 DNA1, Class M2, 144A, 5,017 %, fällig 25.01.2045	5.503
New Residential Mortgage Loan Trust 2017-1, Series 2017 1A, Class B6, 144A, 5,288 %, fällig 25.02.2057	4.009	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA2, Series 2022 DNA2, Class B2, 144A, 12,848 %, fällig 25.02.2042	5.395
BRES Commercial Mortgage Trust 2025-ATCAP, Series 2025 ATCAP, Class F, 144A, 8,848 %, fällig 15.11.2042	3.990	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-DNA6, Series 2021 DNA6, Class B2, 144A, 11,848 %, fällig 25.10.2041	5.234
Greystone CRE Notes 2025 HC-4 LLC, Series 2025 HC4, Class D, 144A, 7,600 %, fällig 15.10.2042	3.990	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, Series 2016 C06, Class 1B, 13,713 %, fällig 25.04.2029	5.213
New Residential Mortgage Loan Trust 2026-NQM3, Series 2026 NQM3, Class A3, 144A, 5,189 %, fällig 25.02.2066	3.950	Freddie Mac STACR Debt Notes 2016-DNA1, Series 2016 DNA1, Class B, 14,463 %, fällig 25.07.2028	5.039
BF 2019-NYT Mortgage Trust, Series 2019 NYT, Class D, 144A, 5,957 %, fällig 15.12.2035	3.949	Two Harbors Investment Corp, 6,250 %, fällig 15.01.2026	5.000
EFMT 2026-NQM1, Series 2026 NQM1, Class B1, 144A, 6,535 %, fällig 25.02.2071	3.500	Towd Point Mortgage Trust 2018-4 144A, 3,298 %, fällig 25.06.2058	4.911
Santander Mortgage Asset Receivable Trust 2025-NQM2, Series 2025 NQM2, Class A3, 144A, 6,036 %, fällig 25.02.2065	3.500	BHMS 2018-MZB, 11,275 %, fällig 01.02.2026	4.491
Atrium Hotel Portfolio Trust 2017-ATRM, Series 2017 ATRM, Class E, 144A, 7,007 %, fällig 15.12.2036	3.427	Freddie Mac STACR Trust 2019-DNA3, Series 2019 DNA3, Class B2, 144A, 12,613 %, fällig 25.07.2049	4.410
New Residential Mortgage Loan Trust 2018-1, Series 2018 1A, Class B6, 144A, 5,605 %, fällig 25.12.2057	3.388	Fannie Mae Connecticut Avenue Securities, 8,186 %, fällig 25.03.2031	4.229
MF1 2025-FL19 LLC, Series 2025 FL19, Class A, 144A, 5,152 %, fällig 18.05.2042	3.352	UBS Commercial Mortgage Trust 2018-NYCH 144A, 8,180 %, fällig 15.02.2032	4.000
Opteum Mortgage Acceptance Corp Trust 2006-1, Series 2006 1, Class 1AC1, 4,388 %, fällig 25.04.2036	3.351	Freddie Mac STACR REMIC Trust 2021-HQA4, Series 2021 HQA4, Class B2, 144A, 11,348 %, fällig 25.12.2041	3.802
Business Jet Securities 2024-1 LLC, Series 2024 1A, Class B, 144A, 6,924 %, fällig 15.05.2039	3.304	Verus Securitization Trust 2022-6, Series 2022 6, Class A1, 144A, 4,910 %, fällig 25.06.2067	3.102
A10 2025-FL6 Issuer LLC, Series 2025 FL6, Class A, 144A, 5,145 %, fällig 15.05.2042	3.242		

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

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	245.234	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	211.580
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	80.980	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	81.099
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	67.913	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	67.945
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	61.918	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	61.744
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	60.108	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	60.280
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	60.065	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	60.000
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	55.260	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	55.346
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	52.977	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	52.911
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	49.118	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	49.123
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	48.522	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	48.606
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.130	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	47.278
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	45.496	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	45.434
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	45.218	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	45.284
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	42.552	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	42.575
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.362	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.453
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.325	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	40.274
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.712	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.684
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.695	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.678
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.512	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	37.635
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	36.599	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	36.677
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	35.570	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	35.809
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.160	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	35.130
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	34.801	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 3,000 %	34.901
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	34.452	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	34.823
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	34.065	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 4,000 %	34.586
Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.793	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	34.173
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.509	Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.846
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	32.578	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	33.453
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	32.606
		Fannie Mae oder Freddie Mac, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	31.987

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

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE			
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.407	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	3.882
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 30.06.2032	1.668	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.10.2025	300
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 21.10.2025	296	Ford Motor Credit Co LLC, 4,950 %, fällig 28.05.2027	228
United States Treasury Note/Bond, 4,000 %, fällig 31.03.2030	211	CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp, 4,500 %, fällig 01.05.2032	202
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	200	Wynn Macau Ltd, 144A, 5,625 %, fällig 26.08.2028	200
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,500 %	196	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	200
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	196	Ford Motor Credit Co LLC, 4,000 %, fällig 13.11.2030	198
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	195	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	196

[^] 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)

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 31.07.2027	190	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	196
Goldman Sachs Group Inc/The, 4,516 %, fällig 21.01.2032	120	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	195
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100	Delta Air Lines Inc, 7,375 %, fällig 15.01.2026	150
Ginnie Mae II Pool 'MB0365', 5,000 %, fällig 20.05.2055	100	Citigroup Inc, 5,500 %, fällig 13.09.2025	150
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	98	Morgan Stanley, 2,188 %, fällig 28.04.2026	110
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98	Delta Air Lines Inc / SkyMiles IP Ltd, 144A, 4,750 %, fällig 20.10.2028	106
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98	Western Midstream Operating LP, 5,250 %, fällig 01.02.2050	104
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	98	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	100
Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	98	AbbVie Inc, 3,600 %, fällig 14.05.2025	100
Ginnie Mae II Pool 'MB0484', 5,000 %, fällig 20.07.2055	98	Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	100
Ginnie Mae II Pool 'MB0554', 4,500 %, fällig 20.08.2055	98	Ginnie Mae II Pool 'MB0365', 5,000 %, fällig 20.05.2055	100
Ginnie Mae II Pool 'MB0744', 4,500 %, fällig 20.11.2055	97	Ginnie Mae II Pool 'MB0484', 5,000 %, fällig 20.07.2055	98
		Ginnie Mae II Pool 'MB0554', 4,500 %, fällig 20.08.2055	98
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 5,000 %	98
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	98
		Ginnie Mae II Pool 'MB0744', 4,500 %, fällig 20.11.2055	98
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 4,500 %	97
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97
		Ginnie Mae, 30 Jahre, TBA, 0,000 %	97

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	30.549	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	31.079
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	16.149	United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	17.200
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	14.616	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	14.892
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	13.636	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	14.586
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	12.270	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	11.856
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	11.861	United States Treasury Floating Rate Note, 4,451 %, fällig 31.10.2025	9.506
United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027	10.031	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	8.762
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	8.536	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	8.554
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	6.856	United States Treasury Floating Rate Note, 4,324 %, fällig 30.04.2026	8.244
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055	6.003	United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 31.07.2034	7.023
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	3.781	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	6.942
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	3.731	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055	6.036
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	3.307	United States Treasury Floating Rate Note, 4,365 %, fällig 31.07.2025	5.950
United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.10.2032	2.848	United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	5.836
Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	2.811	United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	3.612
Kolumbien, TES, Serie B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	1.666	United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	2.882
Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), 144A, 3,250 %, fällig 25.05.2055	1.357	United States Treasury Note/Bond, 3,750 %, fällig 31.10.2032	2.844
Queensland Treasury Corp, 144A, 5,250 %, fällig 21.07.2036	1.280	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	1.774
Inter-American Development Bank, 6,850 %, fällig 18.02.2036	1.224	Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	1.515
Norwegen, Staatsanleihe, Serie 479, 144A, 1,750 %, fällig 17.02.2027	942	Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), 144A, 3,250 %, fällig 25.05.2055	1.327

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund^

	ANSCAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	78.486	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	81.314
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	36.447	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	31.152
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	21.026	United States Treasury Floating Rate Note, 4,436 %, fällig 30.04.2026	18.022
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	16.480	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	16.464
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	13.040	United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	16.201
United States Treasury Floating Rate Note, 4,436 %, fällig 30.04.2026	7.885	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	13.351
Fannie Mae Interest Strip 445, 5,650 %, fällig 25.03.2055	6.210	Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	10.605
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	6.010	Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	8.706
Fannie Mae REMICS, Series 2025 9, Class FC, 4,967 %, fällig 25.03.2055	4.920	Fannie Mae Interest Strip 445, 5,650 %, fällig 25.03.2055	6.229
Philippinen, Staatsanleihe, Serie 1073, 6,375 %, fällig 28.04.2035	4.851	Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	6.160
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN F, 10,000 %, fällig 01.01.2033	4.569	Republik Südafrika, Staatsanleihe, 8,750 %, fällig 28.02.2048	6.107
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	4.408	Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	5.651
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 03.02.2026	4.186	Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.07.2025	5.079
Fannie Mae Interest Strip 445, Class F6, 5,598 %, fällig 25.03.2055	4.072	Kolumbien, TES, 7,250 %, fällig 26.10.2050	4.891
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.08.2026	3.871	Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 03.02.2026	4.870
Fannie Mae REMICS, Series 2024 79, Class FA, 5,448 %, fällig 25.11.2054	3.670	Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 01.04.2025	4.766
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 14.10.2025	3.606	Philippinen, Staatsanleihe, Serie 1073, 6,375 %, fällig 28.04.2035	4.726
Freddie Mac REMICS 5470, Class FA, 4,767 %, fällig 25.11.2054	3.432	Republik Polen, Staatsanleihe, Series CPI, 2,000 %, fällig 25.08.2036	4.665
Freddie Mac REMICS 5473, Class FN, 4,917 %, fällig 25.11.2054	3.275	Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 14.10.2025	4.402
Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	2.766	Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	4.316
		United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	4.303
		Fannie Mae Interest Strip 445, Class F6, 5,598 %, fällig 25.03.2055	4.086
		Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	4.030

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Fixed Income Absolute Return Fund[^] – (Fortsetzung)

		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN ^F , 10,000 %, fällig 01.01.2035		4.023
Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054		3.841
Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055		3.813
Fannie Mae REMICS, Series 2024 79, Class FA, 5,448 %, fällig 25.11.2054		3.703
Fannie Mae REMICS, Series 2025 9, Class FC, 4,967 %, fällig 25.03.2055		3.596

FTGF Brandywine Global High Yield Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	29.099	27.734
TransDigm Inc, 144A, 6,750 %, fällig 15.08.2028	1.329	1.000
Travel + Leisure Co, 144A, 6,625 %, fällig 31.07.2026	1.326	676
Molina Healthcare Inc, 144A, 6,250 %, fällig 15.01.2033	1.033	638
IQVIA Inc, 144A, 5,000 %, fällig 15.10.2026	1.000	635
MercadoLibre Inc, 2,375 %, fällig 14.01.2026	992	627
Panther Escrow Issuer LLC, 144A, 7,125 %, fällig 01.06.2031	852	626
EG Global Finance Plc, 144A, 12,000 %, fällig 30.11.2028	827	
FirstCash Inc, 144A, 5,625 %, fällig 01.01.2030	776	625
Boise Cascade Co, 144A, 4,875 %, fällig 01.07.2030	776	600
Gap Inc/The, 144A, 3,875 %, fällig 01.10.2031	757	600
Sabre GLBL Inc, 144A, 10,750 %, fällig 15.11.2029	733	600
Sabre GLBL Inc, 144A, 11,125 %, fällig 15.07.2030	726	585
Dream Finders Homes Inc, 144A, 8,250 %, fällig 15.08.2028	724	551
Covista Inc, 144A, 5,500 %, fällig 01.03.2028	721	549
Howden UK Refinance Plc / Howden UK Refinance 2 Plc / Howden US Refinance LLC, 144A, 7,250 %, fällig 15.02.2031	717	543
Forestar Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.03.2033	712	524
Nationstar Mortgage Holdings Inc 144A, 5,500 %, fällig 15.08.2028	676	514
Ryan Specialty LLC, 144A, 5,875 %, fällig 01.08.2032	660	504
Magnera Corp, 144A, 7,250 %, fällig 15.11.2031	660	502
		500
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		27.734
MercadoLibre Inc, 2,375 %, fällig 14.01.2026		1.000
Nationstar Mortgage Holdings Inc 144A, 5,500 %, fällig 15.08.2028		676
United Wholesale Mortgage LLC, 144A, 5,500 %, fällig 15.11.2025		638
Burford Capital Finance LLC, 6,125 %, fällig 12.08.2025		635
EG Global Finance PLC REGS, 11,000 %, fällig 30.11.2028		627
Matthews International Corp, 144A, 8,625 %, fällig 01.10.2027		626
Connect Finco SARM / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029		625
Graham Holdings Co, 144A, 5,750 %, fällig 01.06.2026		600
CCM Merger Inc, 144A, 6,375 %, fällig 01.05.2026		600
Live Nation Entertainment Inc, 144A, 5,625 %, fällig 15.03.2026		600
Turning Point Brands Inc, 144A, 7,625 %, fällig 15.03.2032		585
Magnera Corp, 144A, 4,750 %, fällig 15.11.2029		551
Viking Cruises Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.09.2027		549
Petroleos Mexicanos, 6,750 %, fällig 21.09.2047		543
Mineral Resources Ltd, 144A, 8,125 %, fällig 01.05.2027		524
Benteler International Austria GmbH REGS, 9,375 %, fällig 15.05.2028		514
Sabre GLBL Inc, 144A, 11,125 %, fällig 15.07.2030		504
NCL Corp Ltd, 144A, 5,875 %, fällig 15.03.2026		502
Nissan Motor Co Ltd, 144A, 3,522 %, fällig 17.09.2025		500

FTGF Brandywine Global Opportunistic Fixed Income Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	151.649	151.074
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	56.730	48.677
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	48.144	48.113
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	36.926	
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035	35.600	47.920
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	33.847	37.223
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	33.800	35.892
United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027	32.472	33.742
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	32.167	24.374
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055	23.069	
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 17.09.2025	21.844	23.953
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 31.07.2034	21.283	23.119
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 15.10.2025	20.513	
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	19.124	20.674
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN ^F , 10,000 %, fällig 01.01.2035	14.247	19.660
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 16.04.2025	13.780	15.739
Vereinigtes Königreich, Gilt, 4,500 %, fällig 07.03.2035	12.519	15.227
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	12.314	13.628
Australien, Staatsanleihe, Serie 173, 4,250 %, fällig 21.10.2036	11.347	12.606
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054	10.742	11.229
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051	8.663	8.757
		8.399
		7.539
		7.457
		7.426
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		151.074
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026		48.677
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027		48.113
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027		47.920
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035		37.223
United States Treasury Note/Bond, 4,625 %, fällig 15.02.2035		35.892
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030		33.742
United Kingdom Gilt, 1,250 %, fällig 31.07.2051		24.374
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 16.04.2025		23.953
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.08.2055		23.119
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 17.09.2025		23.052
United Kingdom Gilt, 4,250 %, fällig 31.07.2034		21.117
Bundesrepublik Deutschland, Bundesschatzanweisung, Nullkupon, fällig 15.10.2025		20.674
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055		19.660
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.02.2054		15.739
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054		15.227
United States Treasury Floating Rate Note, 4,425 %, fällig 31.10.2025		13.628
United States Treasury Floating Rate Note, 4,385 %, fällig 30.04.2026		12.606
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027		11.229
Australien, Staatsanleihe, 4,250 %, fällig 21.04.2026		8.757
Republik Südafrika, Staatsanleihe, 8,750 %, fällig 28.02.2048		8.399
Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053		7.539
Kanada, Schatzanweisung, Nullkupon, fällig 22.10.2025		7.457
Kanada, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 07.05.2025		7.426

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	450.373	431.175
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN ^F , 10,000 %, fällig 01.01.2033	36.294	52.535
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053	34.704	26.226
Mexiko, Bonos, Serie M, 8,000 %, fällig 31.07.2053	31.194	25.661
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054	27.154	25.280
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN ^F , 10,000 %, fällig 01.01.2035	17.604	
		20.063
		18.781
		18.162
WICHTIGSTE VERKÄUFE		
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)		431.175
United Kingdom Gilt, 3,750 %, fällig 22.10.2053		52.535
United Kingdom Gilt, 4,375 %, fällig 31.07.2054		26.226
Ägypten, Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 06.05.2025		25.661
Mexiko, Bonos, Serie M, 7,500 %, fällig 26.05.2033		25.280
Brasilien, Notas do Tesouro Nacional Serie F, Serie NTN ^F , 10,000 %, fällig 01.01.2027		20.063
Mexiko, Bonos, Series M, 8,500 %, fällig 01.03.2029		18.781
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 28.10.2025		18.162

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund[^] – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 28.04.2026	17.420	Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 29.07.2025	14.210
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 28.10.2025	16.743	Graham Packaging Co Inc, 144A, 7,125 %, fällig 15.08.2028	12.644
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 29.07.2025	12.904	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	12.618
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	12.615	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1, Series 2020 SBT1, Class 2M2, 144A, 8,113 %, fällig 25.02.2040	12.584
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	12.050	EchoStar Corp, 6,750 %, fällig 30.11.2030	12.452
Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	11.237	Freedom Mortgage Corp 144A, 7,625 %, fällig 01.05.2026	12.355
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	10.673	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	12.055
Kolumbien, TES, Serie B, 11,500 %, fällig 25.07.2046	10.289	Mohegan Tribal Gaming Authority, 8,000 %, fällig 01.02.2026	11.720
Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 22.07.2025	9.938	Blue Owl Technology Finance Corp 144A, 3,750 %, fällig 17.06.2026	11.427
Connecticut Avenue Securities Trust 2022-R04, Series 2022 R04, Class 1B1, 144A, 8,917 %, fällig 25.03.2042	9.735	Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 22.07.2025	10.771
Ginnie Mae II Pool 'MB0148', 6,000 %, fällig 20.01.2055	8.690	Panama, Internationale Staatsanleihe, 4,500 %, fällig 19.01.2063	10.744
Ginnie Mae II Pool 'MB0260', 6,000 %, fällig 20.03.2055	8.669	First Quantum Minerals Ltd 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2027	10.696
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-HQA1, Series 2022 HQA1, Class B1, 144A, 10,667 %, fällig 25.03.2042	8.454		
Citigroup Inc, Series X, 3,875 %, Ewige Anleihe	7.925		

FTGF Brandywine Global Credit Opportunities Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.714	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	2.184
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	1.280	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,333 %, fällig 31.01.2027	1.280
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.08.2025	879	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 05.08.2025	880
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	451	Connecticut Avenue Securities Trust 2024-R05 144A, 6,352 %, fällig 25.07.2044	603
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	450	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	451
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 07.08.2025	165	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	450
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 12.08.2025	165	Connecticut Avenue Securities Trust 2020-R01, Series 2020 R01, Class 1B1, 144A, 7,032 %, fällig 25.01.2040	371
Charles Schwab Corp/The, Series 1, 4,000 %, Ewige Anleihe	97	Ägyptischer Schatzwechsel, Nullkupon, fällig 11.03.2025	316
Forestar Group Inc, 144A, 6,500 %, fällig 15.03.2033	95	Home RE 2023-1 Ltd, Series 2023 1, Class M2, 144A, 9,667 %, fällig 25.10.2033	271
Charter Communications Operating LLC / Charter Communications Operating Capital, 6,100 %, fällig 01.06.2029	78	Connecticut Avenue Securities Trust 2019-R04 144A, 9,670 %, fällig 25.06.2039	257
Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 7,125 %, fällig 30.04.2031	78	Petroleos Mexicanos, 5,350 %, fällig 12.02.2028	254
SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	74	Teine Energy Ltd, 144A, 6,875 %, fällig 15.04.2029	222
AS Mileage Plan IP Ltd, 144A, 5,021 %, fällig 20.10.2029	73	DISH Network Corp, 144A, 11,750 %, fällig 15.11.2027	210
Chord Energy Corp, 144A, 6,750 %, fällig 15.03.2033	45	SM Energy Co, 6,625 %, fällig 15.01.2027	210
Saks Global Enterprises LLC, 144A, 11,000 %, fällig 15.12.2029	42	First Quantum Minerals Ltd, 144A, 8,625 %, fällig 01.06.2031	206
Algoma Steel Inc 144A, 9,125 %, fällig 15.04.2029	27	Braskem Netherlands Finance BV, 144A, 8,500 %, fällig 12.01.2031	200
Accendra Health Inc 144A, 10,000 %, fällig 15.04.2030	20	FIEMEX Energia – Banco Actinver SA Institucion de Banca Multiple, 144A, 7,250 %, fällig 31.01.2041	196
Mohegan Tribal Gaming Authority / MS Digital Entertainment Holdings LLC, 144A, 8,250 %, fällig 15.04.2030	20	Connect Finco SARL / Connect US Finco LLC, 144A, 9,000 %, fällig 15.09.2029	189
New Fortress Energy Inc – Class A	12	CSN Resources SA, 144A, 8,875 %, fällig 05.12.2030	184
Mohegan Tribal Gaming Authority / MS Digital Entertainment Holdings LLC 144A, 11,875 %, fällig 15.04.2031	10	Transocean Titan Financing Ltd, 144A, 8,375 %, fällig 01.02.2028	184
		Bellemeade Re 2022-2 Ltd 144A, 13,602 %, fällig 27.09.2032	173

FTGF Brandywine Global Multi-Sector Impact Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
New Fortress Energy Inc – Class A	13	New Fortress Energy Inc, 144A, 6,500 %, fällig 30.09.2026	13
		New Fortress Energy Inc – Class A	6

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^]

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	11.592	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	11.603
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	11.339	United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	7.595
United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	9.631	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	5.628
United States Treasury Note/Bond, 3,625 %, fällig 31.10.2030	8.664	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,400 %, fällig 30.04.2027	5.619
United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027	7.508	United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	5.613
United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	6.442	United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2033	3.925
United States Treasury Note/Bond, 3,875 %, fällig 15.08.2034	3.346	United States Treasury Floating Rate Note, 3,802 %, fällig 31.07.2027	3.909
United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,375 %, fällig 15.02.2055	3.236	United States Treasury Note/Bond, 4,750 %, fällig 15.05.2055	3.682
United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	2.421	United States Treasury Note/Bond, 3,000 %, fällig 15.08.2052	3.649
United States Treasury Floating Rate Note, 4,482 %, fällig 30.04.2026	1.521	United States Treasury Inflation Indexed Bonds, 2,375 %, fällig 15.02.2055	3.246
United States Treasury Floating Rate Note – bei Ausgabe 4,501 %, fällig 31.10.2026	1.051	United States Treasury Note/Bond, 4,250 %, fällig 15.08.2035	1.938
Citigroup Inc, Series W, 4,000 %, Ewige Anleihe	438	United States Treasury Floating Rate Note, 3,833 %, fällig 31.10.2027	1.793
Charles Schwab Corp/The, 5,375 %, Ewige Anleihe	375	United States Treasury Floating Rate Note, 4,482 %, fällig 30.04.2026	1.521
Citigroup Inc, 5,950 %, Ewige Anleihe	350	Ginnie Mae II Pool 'MB0027', 6,000 %, fällig 20.11.2054	1.079
UBS Group AG, 5,125 %, Ewige Anleihe	328	Ginnie Mae II Pool 'MA9852', 6,000 %, fällig 20.08.2054	1.028

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Brandywine Global – US Fixed Income Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Truist Financial Corp, Series P, 4,950 %, Ewige Anleihe	299	Ginnie Mae II Pool 'MB0206', 6,000 %, fällig 20.02.2055	1.006
United States Treasury Floating Rate Note, 3,742 %, fällig 31.01.2028	280	Ginnie Mae II Pool 'MA9780', 6,000 %, fällig 20.07.2054	909
US Bancorp, Series J, 5,300 %, Ewige Anleihe	143	Ginnie Mae II Pool 'MB0093', 6,000 %, fällig 20.12.2054	800
Ginnie Mae II Pool 'MA9907', 6,000 %, fällig 20.09.2054	95	Ginnie Mae II Pool 'MA9966', 6,000 %, fällig 20.10.2054	752
Charles Schwab Corp/The, Series I, 4,000 %, Ewige Anleihe	84	Ginnie Mae II Pool 'MA9242', 6,000 %, fällig 20.10.2053	712

FTGF Brandywine Global Opportunistic Equity Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	36.257	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	34.263
Baidu Inc ADR	2.631	Dollar General Corp	1.726
BNP Paribas SA	2.554	FedEx Corp	1.418
Dollar General Corp	2.028	Citigroup Inc	1.407
Comcast Corp	1.968	Banco Santander SA	1.320
AerCap Holdings NV	1.830	Bank of America Corp	1.059
Kimberly-Clark Corp	1.787	Delta Air Lines Inc	955
Global Payments Inc	1.738	Ambev SA	878
Salesforce Inc	1.658	Annaly Capital Management Inc	877
Delta Air Lines Inc	1.656	Baidu Inc ADR	819
FedEx Corp	1.603	Alphabet Inc 'A'	680
Banco Santander SA	1.561	CVS Health Corp	571
Abercrombie & Fitch Co	1.540	Conagra Brands Inc	554
Alphabet Inc 'A'	1.509	Wells Fargo & Co	548
Citigroup Inc	1.504	Genmab A/S ADR	532
CVS Health Corp	1.481	BNP Paribas SA	529
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	1.389	Abercrombie & Fitch Co	488
Shimamura Co Ltd	1.299	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	468
ICON Plc	1.298	Magna International Inc	451
Adobe Inc	1.283	FMC Corp	426
Willis Towers Watson Plc	1.237		
Barratt Redrow Plc	1.184		
Constellation Software Inc/Canada	1.179		

FTGF ClearBridge US Value Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Alphabet Inc 'A'	29.572	Micron Technology Inc	32.644
Amazon.com Inc	23.172	American International Group Inc	25.245
Intel Corp	20.323	Johnson & Johnson	25.072
PepsiCo Inc	18.983	AbbVie Inc	24.572
Salesforce Inc	16.488	Bank of America Corp	21.678
Walt Disney Co/The	16.364	Gilead Sciences Inc	21.456
Canadian Pacific Kansas City Ltd	15.078	Intel Corp	20.501
Becton Dickinson & Co	13.729	EQT Corp	20.199
Charter Communications Inc	13.364	Canadian Pacific Kansas City Ltd	20.147
Newmont Corp	13.186	Meta Platforms Inc 'A'	19.542
Expedia Group Inc	13.029	Vistra Corp	19.016
Intercontinental Exchange Inc	12.353	Nestle SA ADR	19.012
BP Plc ADR	11.819	Expedia Group Inc	17.619
Fifth Third Bancorp	11.668	OneMain Holdings Inc	17.402
Corcept Therapeutics Inc	11.410	Capital One Financial Corp	16.463
Amdocs Ltd	11.150	Argenx SE ADR	16.325
Capital One Financial Corp	10.540	Oracle Corp	16.307
Vistra Corp	10.153	PepsiCo Inc	16.001
Elanco Animal Health Inc	10.111	Corebridge Financial Inc	15.397
Globant SA	9.248	ICON Plc	15.355
International Flavors & Fragrances Inc	8.624	Siemens AG	15.299
Global Payments Inc	8.546	PayPal Holdings Inc	15.287
Keurig Dr Pepper Inc	8.525	UnitedHealth Group Inc	15.045
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	8.387	Uber Technologies Inc	14.746
TFI International Inc	6.962	Constellation Brands Inc 'A'	14.482
UnitedHealth Group Inc	6.148	Newmont Corp	14.368
Kinetik Holdings Inc 'A'	5.379	T-Mobile US Inc	14.329
Contemporary Amperex Technology Co Ltd	5.284	Walt Disney Co/The	14.298
Webster Financial Corp	5.191	Novo Nordisk A.S ADR	14.261
Celsius Holdings Inc	5.004	Microchip Technology Inc	14.221
Chevron Corp	4.857	Talen Energy Corp	13.897
TG Therapeutics Inc	4.650	Freeport-McMoRan Inc	13.753
		CVS Health Corp	13.526
		Noble Corp PLC	13.316
		BP Plc ADR	12.994
		MGIC Investment Corp	12.993
		DraftKings Inc	12.061
		Global Payments Inc	12.028
		Teck Resources Ltd	11.523
		M&T Bank Corp	11.266
		American Tower Corp	10.977
		Alphabet Inc 'A'	10.890
		Block Inc	10.744

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Putnam US Research Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	390.978	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	364.524
NVIDIA Corp	98.130	Tesla Inc	18.880
Microsoft Corp	91.822	Intel Corp	15.052
Apple Inc	64.612	NVIDIA Corp	13.306
Alphabet Inc 'A'	60.244	Apple Inc	11.587
Amazon.com Inc	58.336	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 23.04.2026	10.900
Broadcom Inc	43.224	Seagate Technology Holdings Plc	10.817
Meta Platforms Inc 'A'	35.626	Oracle Corp	10.054
Analog Devices Inc	31.085	Microsoft Corp	9.596
Tesla Inc	29.782	Pure Storage Inc	7.754
Cisco Systems Inc	28.428	JPMorgan Chase & Co	6.715
Lam Research Corp	27.987	Lam Research Corp	6.491
Oracle Corp	26.434	Berkshire Hathaway Inc	6.343
Marvell Technology Inc	23.212	FedEx Corp	5.758
Mastercard Inc	22.951	Analog Devices Inc	5.611
Advanced Micro Devices Inc	22.550	Progressive Corp/The	5.171
Exxon Mobil Corp	21.521	ROBLOX Corp	5.098
Eli Lilly & Co	19.644	Barrick Mining Corp	4.790
Pure Storage Inc	18.613	AT&T Inc	4.465
Honeywell International Inc	17.443	Visa Inc 'A'	4.431

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Oracle Corp	53.448	NVIDIA Corp	116.647
Vertex Pharmaceuticals Inc	27.566	Amazon.com Inc	76.854
Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	25.165	Microsoft Corp	72.312
Linde Plc	24.473	Meta Platforms Inc 'A'	44.148
Broadcom Inc	22.457	Apple Inc	39.326
Arista Networks Inc	21.797	Workday Inc 'A'	31.627
ServiceNow Inc	19.410	Salesforce Inc	31.132
Marvell Technology Inc	15.759	Visa Inc 'A'	30.864
Fair Isaac Corp	15.360	PayPal Holdings Inc	29.626
Roche Holding AG ADR	14.369	Union Pacific Corp	28.129
Starbucks Corp	12.769	UnitedHealth Group Inc	27.289
Datadog Inc	11.008	Zoetis Inc	26.771
Alphabet Inc 'A'	10.632	Tesla Inc	25.683
Meta Platforms Inc 'A'	10.288	Alphabet Inc 'A'	25.523
Parker-Hannifin Corp	10.036	Equinix Inc	24.937
Thermo Fisher Scientific Inc	8.234	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	24.182
Intuitive Surgical Inc	7.158	Starbucks Corp	21.991
Airbnb Inc	7.034	Eli Lilly & Co	21.249
Marsh & McLennan Cos Inc	5.692	Netflix Inc	21.200
Texas Instruments Inc	5.654	Accenture Plc 'A'	19.816
Netflix Inc	5.558	Monster Beverage Corp	18.618
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd ADR	5.454	ASML Holding NV	18.556
Eaton Corp Plc	5.112	Target Corp	18.053
Synopsys Inc	5.073	Marvell Technology Inc	18.050
Apple Inc	4.742	Adobe Inc	16.566
Tesla Inc	4.377	S&P Global Inc	16.238
		Intuit Inc	15.819
		Thermo Fisher Scientific Inc	13.039
		Uber Technologies Inc	12.120
		Palo Alto Networks Inc	10.516
		Eaton Corp Plc	10.434
		Stryker Corp	10.177

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Hilton Worldwide Holdings Inc	4.107	Broadcom Inc	18.759
Axon Enterprise Inc	3.443	TE Connectivity Plc	13.890
Vistra Corp	3.277	Vertex Pharmaceuticals Inc	10.456
Alnylam Pharmaceuticals Inc	2.534	CrowdStrike Holdings Inc	9.866
ROBLOX Corp	2.523	Vertiv Holdings Co 'A'	8.244
Howmet Aerospace Inc	1.840	Autodesk Inc	8.086
On Holding AG	1.113	TJX Cos Inc/The	7.619
Sherwin-Williams Co/The	813	Johnson Controls International plc	7.164
XPO Inc	811	Palantir Technologies Inc	6.628
Cava Group Inc	775	Robinhood Markets Inc	6.554
Natera Inc	719	AppLovin Corp 'A'	6.239
TKO Group Holdings Inc – Class A	527	HubSpot Inc	6.020
Palantir Technologies Inc	453	Shopify Inc – Class A	5.574
MSCI Inc 'A'	395	Snowflake Inc	4.694
Robinhood Markets Inc	326	Madison Square Garden Sports Corp	4.546
Snowflake Inc	239	Freeport-McMoRan Inc	4.444
Pinterest Inc	189	Airbnb Inc	4.304
Insulet Corp	167	ServiceNow Inc	4.286
Clean Harbors Inc	153	Vistra Corp	4.115
elf Beauty Inc	146	Alnylam Pharmaceuticals Inc	4.113
		Pinterest Inc	4.070
		WW Grainger Inc	4.055

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge US Aggressive Growth Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Hilton Worldwide Holdings Inc	4.049
Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	3.966
MSCI Inc 'A'	3.921
UnitedHealth Group Inc	3.738
Insulet Corp	3.731
Ares Management Corp 'A'	3.544
Cintas Corp	3.301
Axon Enterprise Inc	3.151
Tractor Supply Co	3.020
Accenture Plc 'A'	2.990
Old Dominion Freight Line Inc	2.974
Doximity Inc	2.880
IDEXX Laboratories Inc	2.477
elf Beauty Inc	2.386

FTGF ClearBridge Tactical Dividend Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

Marvell Technology Inc	1.153
PepsiCo Inc	981
DTE Energy Co	877
Ares Management Corp 'A'	849
VICI Properties Inc 'A'	811
Kinder Morgan Inc	620
Procter & Gamble Co/The	598
Verizon Communications Inc	572
Walmart Inc	568
Colgate-Palmolive Co	560
Shift4 Payments Inc	522
Eaton Corp Plc	516
Freeport-McMoRan Inc	498
QXO Inc	484
Atmos Energy Corp	479
KKR & Co Inc, Series D	479
Apple Inc	471
McCormick & Co Inc/MD	465
Amphenol Corp 'A'	455
Coca-Cola Co/The	435
Equity LifeStyle Properties Inc	419
Prologis Inc	407
Northrop Grumman Corp	399
Abbott Laboratories	381
NextEra Energy Inc	367
Microsoft Corp	366
TC Energy Corp	360
Johnson & Johnson	308
Lennar Corp	304
Digital Realty Trust Inc	273
Salesforce Inc	269
Williams Cos Inc/The	267
Union Pacific Corp	260
Targa Resources Corp	257
PPL Corp	254
L3Harris Technologies Inc	225
UnitedHealth Group Inc	219

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$

WICHTIGSTE VERKÄUFE

PPL Corp	949
PepsiCo Inc	862
Williams Cos Inc/The	849
Broadcom Inc	849
Hewlett Packard Enterprise Co	776
Salesforce Inc	763
Marvell Technology Inc	708
Ares Management Corp, Series B	698
Procter & Gamble Co/The	668
Ares Capital Corp	650
Kinder Morgan Inc	649
Blue Owl Capital Inc 'A'	640
Johnson & Johnson	571
Apple Inc	548
Honeywell International Inc	543
Microsoft Corp	527
Verizon Communications Inc	506
Oracle Corp	505
Blackstone Inc	494
Shift4 Payments Inc	479
NXP Semiconductors NV	460
American Homes 4 Rent 'A'	459
Plains GP Holdings LP, MLP 'A'	457
Coca-Cola Co/The	453
Cheniere Energy Inc	444
Otis Worldwide Corp	436
AbbVie Inc	421
Gaming and Leisure Properties Inc REIT	415
Equinix Inc	407
McCormick & Co Inc/MD	399
QXO Inc	386
Apollo Global Management Inc	369
Colgate-Palmolive Co	356
Lineage Inc	318
Equity Residential	309
JPMorgan Chase & Co	294
Public Service Enterprise Group Inc	289
ONEOK Inc	282
UnitedHealth Group Inc	265
Equity LifeStyle Properties Inc	256
Intercontinental Exchange Inc	246

ERLÖSE (in Tsd.) \$

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund

WICHTIGSTE KÄUFE

NVIDIA Corp	20.612
Netflix Inc	19.949
Linde Plc	19.075
Analog Devices Inc	18.304
Palo Alto Networks Inc	14.817
TJX Cos Inc/The	14.184
CenterPoint Energy Inc	12.577
US Foods Holding Corp	12.273
Clean Harbors Inc	10.888
Flowserve Corp	10.828
PTC Inc	9.961
Johnson & Johnson	9.926
Ferguson Enterprises Inc	9.516
UL Solutions Inc 'A'	8.974
Valmont Industries Inc	8.736

ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$

WICHTIGSTE VERKÄUFE

Microsoft Corp	36.361
Broadcom Inc	34.858
Amazon.com Inc	26.279
Apple Inc	23.790
NVIDIA Corp	20.589
Booking Holdings Inc	19.303
Alphabet Inc 'A'	17.185
Colgate-Palmolive Co	15.682
Morgan Stanley	15.541
Bank of America Corp	15.535
JPMorgan Chase & Co	15.064
Accenture Plc 'A'	14.570
Lam Research Corp	13.982
Travelers Cos Inc/The	13.767
CVS Health Corp	13.420

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund – (Fortsetzung)

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Brookfield Renewable Partners LP	8.449	Deere & Co	13.189
Alphabet Inc 'A'	7.745	ServiceNow Inc	12.590
Procter & Gamble Co/The	7.330	Walt Disney Co/The	12.469
Oracle Corp	7.220	UnitedHealth Group Inc	11.726
Deere & Co	6.853	PTC Inc	11.674
ASM International NV	6.427	Costco Wholesale Corp	11.643
Amazon.com Inc	6.220	American Water Works Co Inc	11.583
Monday.com Ltd	5.541	Home Depot Inc/The	11.581
AppLovin Corp 'A'	5.320	Vulcan Materials Co	11.417
Bank of America Corp	5.210	Salesforce Inc	11.364
United Rentals Inc	4.545	McKesson Corp	10.794
Danaher Corp	4.457	LKQ Corp	10.407
Republic Services Inc 'A'	4.432	Hartford Insurance Group Inc/The	10.070
Vulcan Materials Co	3.499	Republic Services Inc 'A'	9.772
		Visa Inc 'A'	9.708
		Procter & Gamble Co/The	9.657
		Johnson & Johnson	9.562
		Analog Devices Inc	9.549
		ASML Holding NV	9.462
		Eaton Corp Plc	9.455
		Flowserve Corp	8.986
		United Rentals Inc	8.627
		Regal Rexnord Corp	8.593
		Trex Co Inc	8.457
		Prologis Inc	8.217
		Novo Nordisk A.S ADR	8.196
		Netflix Inc	7.880
		Gilead Sciences Inc	7.875
		Trane Technologies Plc	7.580
		Synopsys Inc	7.470

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund

	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		ERLÖSE (in Tsd.) \$
WICHTIGSTE KÄUFE		WICHTIGSTE VERKÄUFE	
Broadcom Inc	12.980	TE Connectivity Plc	10.991
NVIDIA Corp	12.451	Broadcom Inc	8.884
TE Connectivity Plc	11.029	Autodesk Inc	7.129
Microsoft Corp	9.004	Vertex Pharmaceuticals Inc	6.851
Alphabet Inc 'A'	8.473	TJX Cos Inc/The	6.417
Vertex Pharmaceuticals Inc	8.387	CrowdStrike Holdings Inc	6.146
Johnson Controls International plc	7.718	Shopify Inc – Class A	5.131
Vertiv Holdings Co 'A'	7.429	Robinhood Markets Inc	4.514
Apple Inc	7.425	SK hynix Inc	4.083
Autodesk Inc	7.073	Johnson Controls International plc	4.079
TJX Cos Inc/The	6.199	Vistra Corp	4.041
CrowdStrike Holdings Inc	6.050	Madison Square Garden Sports Corp	3.918
Amazon.com Inc	5.879	Hilton Worldwide Holdings Inc	3.805
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	5.088	Vertiv Holdings Co 'A'	3.798
Tencent Holdings Ltd	5.070	Alnylam Pharmaceuticals Inc	3.633
AppLovin Corp 'A'	4.903	MSCI Inc 'A'	3.609
Shopify Inc – Class A	4.850	Snowflake Inc	3.570
Robinhood Markets Inc	4.506	Airbnb Inc	3.419
Johnson & Johnson	4.069	Insulet Corp	3.407
HDFC Bank Ltd ADR	3.997	Microsoft Corp	3.388
		Ares Management Corp 'A'	3.346
		HubSpot Inc	3.277
		Celestica Inc	3.221
		Freeport-McMoRan Inc	3.212
		Pinterest Inc	3.107
		Axon Enterprise Inc	3.044
		ROBLOX Corp	2.931
		ServiceNow Inc	2.922
		NatWest Group Plc	2.909
		JPMorgan Chase & Co	2.850
		AppLovin Corp 'A'	2.798
		Tractor Supply Co	2.631
		WW Grainger Inc	2.614
		Liberty Media Corp-Liberty Formula One 'C'	2.583
		Cintas Corp	2.418
		Trane Technologies Plc	2.389

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
SSE Plc	57.749	WEC Energy Group Inc	42.351
RWE AG	38.419	Enel SpA	39.785
Engie SA	34.966	Emera Inc	38.596
Public Service Enterprise Group Inc	34.413	SSE Plc	36.723
Brookfield Renewable Corporation	33.675	Redeia Corp SA	31.449
Portland General Electric Co	33.501	DTE Energy Co	26.378
Elia Group SA/NV 'B'	29.816	Iberdrola SA	25.989
PG&E Corp	28.777	United Utilities Group Plc	23.611
Vinci SA	27.030	Cheniere Energy Inc	19.676
CenterPoint Energy Inc	25.696	PG&E Corp	17.465
Entergy Corp	25.496	Dominion Energy Inc	17.280
Ferrovial SE	24.525	NextEra Energy Inc	16.920
Canadian National Railway Co	24.135	Pembina Pipeline Corp	16.785
Severn Trent Plc	23.173	Entergy Corp	15.089
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	22.755	AXIA Energia SA	13.610
Algonquin Power & Utilities Corp	22.290	Vinci SA	13.501
E.ON SE	21.978	Public Service Enterprise Group Inc	12.026
Constellation Energy Corp	21.585	E.ON SE	11.405
Iberdrola SA	21.503	CSX Corp	10.099
ONEOK Inc	21.052	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	9.472
Aena SME SA, 144A	19.867	Canadian National Railway Co	8.225
Williams Cos Inc/The	19.838	Aena SME SA, 144A	8.206
Axia Energia	17.781	TC Energy Corp	7.708
Aeroports de Paris SA	17.522	Ferrovial SE	7.365
CSX Corp	16.920	Constellation Energy Corp	6.413
TC Energy Corp	16.807	APA Group	6.407
Equatorial SA	15.777		
WEC Energy Group Inc	15.111		
NextEra Energy Inc	15.099		
Getlink SE	14.405		
APA Group	11.785		
OGE Energy Corp	11.302		
Union Pacific Corp	11.057		
Redeia Corp SA	10.157		
Enel SpA	9.227		
Terna – Rete Elettrica Nazionale	8.379		

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Enel SpA	21.927	Enel SpA	20.231
Engie SA	19.402	SSE Plc	16.707
Canadian National Railway Co	16.233	Emera Inc	15.900
SSE Plc	13.913	Redeia Corp SA	15.714
Public Service Enterprise Group Inc	10.816	EDP SA	13.734
Iberdrola SA	10.536	Iberdrola SA	13.390
Clearway Energy Inc 'C'	10.388	NextEra Energy Inc	13.381
Williams Cos Inc/The	9.226	WEC Energy Group Inc	11.623
Portland General Electric Co	8.825	Union Pacific Corp	11.363
Axia Energia	8.725	Crown Castle Inc	9.930
APA Group	8.638	Dominion Energy Inc	9.833
South Bow Corp	8.005	E.ON SE	8.860
Getlink SE	7.948	Pembina Pipeline Corp	7.912
Aena SME SA, 144A	7.484	CPFL Energia SA	7.771
E.ON SE	7.244	National Grid Plc	7.613
Edison International	7.173	Severn Trent Plc	7.097
Cia Paranaense de Energia – Copel	7.038	Centrais Eletricas Brasileiras SA	6.950
Vinci SA	6.960	Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	5.188
Snam SpA	6.937	Vinci SA	5.152
Aeroports de Paris SA	6.163	Snam SpA	4.625
EDP SA	6.083	Public Service Enterprise Group Inc	3.802
Brookfield Renewable Corporation	6.032	Italgas SpA	3.719
Enbridge Inc	5.768	Constellation Energy Corp	3.538
NextEra Energy Inc	5.465	Pennon Group Plc	3.193
Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV 'B'	5.381		
TC Energy Corp	5.357		
Enav SpA, 144A	5.249		
Constellation Energy Corp	4.385		
Entergy Corp	3.788		
Cia Paranaense de Energia – Copel	2.731		

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Alphabet Inc 'A'	313	Piraeus Financial Holdings SA ADR	250
Lloyds Banking Group Plc	225	PayPal Holdings Inc	210
Walt Disney Co/The	211	Uber Technologies Inc	150
Brookfield Renewable Corporation	157	ICON Plc	143
Merck KGaA	156	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	135
Nestle SA ADR	137	Siemens Energy AG	106
Microchip Technology Inc	135	Oracle Corp	92
Novo Nordisk A/S	100	Fiserv Inc	84
Corcept Therapeutics Inc	93	Nexans SA	77
Fortune Brands Innovations Inc	87	Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	71
Teck Resources Ltd	53	Novo Nordisk A/S	68
Oracle Corp	9	Coty Inc	47
Meta Platforms Inc 'A'	3	Corcept Therapeutics Inc	46
Siemens Energy AG	1	Magnum Ice Cream Co NV/The	11
		Vertiv Holdings Co 'A'	1

FTGF Royce US Small Cap Opportunity Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	322.595	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	301.991
Gentherm Inc	7.534	Kratos Defense & Security Solutions Inc	15.013
FTAI Infrastructure Inc	6.784	nLight Inc	13.071
Globant SA	6.314	Coherent Corp	10.294
Amentum Holdings Inc	6.167	FARO Technologies Inc	9.896
Parsons Corp	6.111	Astronics Corp	9.822
Teleflex Inc	6.032	WNS Holdings Ltd	8.848
Materion Corp	5.992	BWX Technologies Inc	8.693
Public Policy Holding Co Inc	5.707	FormFactor Inc	8.114
Ameresco Inc 'A'	5.705	Chart Industries Inc	7.932
Universal Technical Institute Inc	5.644	Primoris Services Corp	7.657
Innoviva Inc	5.267	Ultra Clean Holdings Inc	7.222
SiteOne Landscape Supply Inc	5.160	Garrett Motion Inc	7.171
Euronet Worldwide Inc	5.061	ATI Inc	7.131
EPAM Systems Inc	5.008	VZX Inc	7.072
Robert Half Inc	4.934	American Superconductor Corp	7.054
Limbach Holdings Inc	4.929	CECO Environmental Corp	6.611
elf Beauty Inc	4.785	Healthcare Services Group Inc	6.288
Abercrombie & Fitch Co	4.760	Artivion Inc	6.099
LSI Industries Inc	4.715	Modine Manufacturing Co	6.001

FTGF Royce US Smaller Companies Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	24.567	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	24.355
iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	3.061	Sanmina Corp	3.428
State Street SPDR Portfolio S&P 600 Small Cap ETF – ETF	2.377	iShares Russell 2000 Value ETF – ETF	2.968
Kadant Inc	1.716	MKS Inc	2.958
Maximus Inc	1.664	FormFactor Inc	2.384
Exponent Inc	1.625	Installed Building Products Inc	2.079
Esab Corp	1.504	Sterling Infrastructure Inc	1.974
RLI Corp	1.363	Haemonetics Corp	1.932
Interparfums Inc	1.216	Kennedy-Wilson Holdings Inc	1.860
Korn Ferry	1.211	Air Lease Corp 'A'	1.843
Matson Inc	1.116	Enovis Corp	1.675
WD-40 Co	1.111	Ziff Davis Inc	1.403
AAON Inc	1.093	Weatherford International Plc	1.304
Valvoline Inc	1.091	Marcus & Millichap Inc	1.303
Saia Inc	1.071	Forrester Research Inc	1.282
M/I Homes Inc	1.011	LCI Industries	1.167
Arrow Electronics Inc	957	ESCO Technologies Inc	1.146
Catalyst Pharmaceuticals Inc	957	Janus International Group Inc	1.140
Onto Innovation Inc	855	Arrow Electronics Inc	1.130
LCI Industries	837	Dun & Bradstreet Holdings Inc	1.084
Visteon Corp	828	Houlihan Lokey Inc 'A'	1.063
Quaker Chemical Corp	786	Halozyme Therapeutics Inc	1.056
Enovis Corp	765	Axcelis Technologies Inc	1.028
United States Lime & Minerals Inc	759	Esab Corp	1.020
Cirrus Logic Inc	753	Leonardo DRS Inc	893
		JBT Marel Corp	873
		White Mountains Insurance Group Ltd	855

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Royce Global Small Cap Premier Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.218	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	1.183
Exponent Inc	94	MKS Inc	133
Morningstar Inc	68	JTC Plc, 144A	127
Cochlear Ltd	62	Johns Lyng Group Ltd	105
SOL SpA	61	Marlowe PLC	85
Victory Capital Holdings Inc 'A'	58	Haemonetics Corp	70
Business Engineering Corp	58	Hirose Electric Co Ltd	65
Triveni Turbine Ltd	55	Installed Building Products Inc	62
FirstService Corp	52	Littelfuse Inc	59
AIA Engineering Ltd	51	Asseco Poland SA	58
CAE Inc	49	IPH Ltd	57
AAON Inc	48	GVS SpA 144A	53
Simpson Manufacturing Co Inc	44	Enovis Corp	53
Brunswick Corp.DE	43	Valmont Industries Inc	52
Valmont Industries Inc	42	JCU Corp	51
WD-40 Co	40	Arcosa Inc	50
Baltic Classifieds Group Plc	40	LCI Industries	49
Hirose Electric Co Ltd	39	Norva24 Group AB	48
Dexerials Corp	38	Odontoprev SA	45
Accelleron Industries AG	37	SEI Investments Co	45
Brady Corp 'A'	37	As One Corp	43
LCI Industries	36	Hansen Technologies Ltd	38
USS Co Ltd	36	Innospec Inc	38
UFP Industries Inc	35	NICE Information Service Co Ltd	36
MSA Safety Inc	32	Kennedy-Wilson Holdings Inc	36
Quaker Chemical Corp	31	Auktion Technology Group Plc	35
Onto Innovation Inc	31	Quaker Chemical Corp	33
		DiaSorin SpA	31
		ESCO Technologies Inc	31

FTGF Franklin Global Long Term Unconstrained Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	7.435	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	7.633
Tencent Holdings Ltd	540	NVIDIA Corp	2.113
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	487	Microsoft Corp	1.799
AstraZeneca Plc	486	ASML Holding NV	1.098
Microsoft Corp	407	Apple Inc	1.094
Amazon.com Inc	360	L'Oreal SA	980
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	269	Ferrari NV	951
Broadcom Inc	239	Meta Platforms Inc 'A'	936
Alibaba Group Holding Ltd	200	Mastercard Inc	903
ServiceNow Inc	190	Linde Plc	840
Visa Inc 'A'	182	Sartorius Stedim Biotech	791
Trane Technologies Plc	181	Moncler SpA	778
Apple Inc	174	Veeva Systems Inc 'A'	776
Galderma Group AG	129	Atlas Copco AB	752
Intuitive Surgical Inc	121	Autodesk Inc	744
L'Oreal SA	109	Adyen NV, 144A	736
Fujikura Ltd	96	Cadence Design Systems Inc	726
Mastercard Inc	67	IDEXX Laboratories Inc	722
Meta Platforms Inc 'A'	65	ResMed Inc	686
NVIDIA Corp	29	Kingspan Group Plc	639
		Tencent Holdings Ltd	599
		Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	568
		AstraZeneca Plc	528
		Zoetis Inc	524
		Mettler-Toledo International Inc	517
		Constellation Software Inc/Canada	510
		Deckers Outdoor Corp	490
		Partners Group Holding AG	454
		Novo Nordisk A/S	447
		BE Semiconductor Industries NV	435
		CSL Ltd	393
		Amazon.com Inc	350

FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	10.804	Western Asset Liquidity Funds Plc – Western Asset US Dollar Liquidity Fund, Klasse WA (ausschüttend)	10.299
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	777	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	3.266
Quanta Computer Inc	506	Tencent Holdings Ltd	2.124
Localiza Rent a Car SA	449	Samsung Electronics Co Ltd	1.664
MediaTek Inc	389	SK hynix Inc	1.279
Apollo Hospitals Enterprise Ltd	341	HDFC Bank Ltd	1.074
Clicks Group Ltd	324	Alibaba Group Holding Ltd	1.024
HD Hyundai Electric Co Ltd	322	MediaTek Inc	975

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Etiad Etisalat Co	309	ICICI Bank Ltd	857
Dino Polska SA, 144A	309	Delta Electronics Inc	790
Dr. Sulaiman Al Habib Medical Services Group Co	283	Quanta Computer Inc	773
Delta Electronics Inc	265	Meituan 'B', 144A	590
Sieyuan Electric Co Ltd	254	Reliance Industries Ltd	584
Trip.com Group Ltd ADR	240	China Merchants Bank Co Ltd	555
Gold Fields Ltd	236	Titan Co Ltd	531
Samsung Electronics Co Ltd	221	Al Rajhi Bank	520
Tencent Holdings Ltd	205	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	515
HDFC Bank Ltd	203	Apollo Hospitals Enterprise Ltd	512
Inter & Co Inc 'A'	200	Capitec Bank Holdings Ltd	484
Bank Central Asia Tbk PT	198	Antofagasta Plc	469
		AIA Group Ltd	466
		Shinhan Financial Group Co Ltd	447
		Contemporary Amperex Technology Co Ltd	439
		B3 SA – Brasil Bolsa Balcao	427
		Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	427
		Mahindra & Mahindra Ltd	417
		Trip.com Group Ltd ADR	417
		MercadoLibre Inc	394

FTGF Franklin European Unconstrained Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
Amundi Core MSCI Europe UCITS ETF – ETF	214	Ferrari NV	7.220
ASM International NV	100	ASML Holding NV	5.582
SAP SE	74	Moncler SpA	5.183
Schneider Electric SE	49	L'Oreal SA	4.335
		Kingspan Group Plc	3.991
		Adyen NV, 144A	3.775
		Linde Plc	3.743
		Sartorius Stedim Biotech	3.698
		Partners Group Holding AG	3.663
		Atlas Copco AB	3.581
		Nemetschek SE	3.353
		Novo Nordisk A/S	3.234
		Mettler-Toledo International Inc	3.203
		Assa Abloy AB	3.114
		Dassault Systemes SE	3.045
		BE Semiconductor Industries NV	2.415
		Schneider Electric SE	2.392
		AstraZeneca Plc	2.288
		Coloplast A.S	1.954
		Hexagon AB	1.824
		Infineon Technologies AG	1.468
		Oxford Nanopore Technologies PLC	1.187
		Galderma Group AG	782

FTGF Martin Currie Improving Society Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
UL Solutions Inc 'A'	448	MercadoLibre Inc	1.370
MercadoLibre Inc	32	Intuitive Surgical Inc	1.113
Intuitive Surgical Inc	29	HDFC Bank Ltd ADR	981
Revvity Inc	24	Airtel Africa Plc, 144A	942
Valmont Industries Inc	24	Novonesis Novozymes B	875
Ecolab Inc	23	Ecolab Inc	817
Xylem Inc.NY	23	Veeva Systems Inc 'A'	816
HDFC Bank Ltd ADR	23	Xylem Inc.NY	798
Veolia Environnement SA	22	Valmont Industries Inc	797
Novonesis Novozymes B	21	Veolia Environnement SA	767
Veeva Systems Inc 'A'	20	Revvity Inc	669
Tyler Technologies Inc	18	Tyler Technologies Inc	626
Deere & Co	16	Deere & Co	608
Amplifon SpA	14	Halma Plc	584
Halma Plc	14	Stride Inc	545
Stride Inc	13	UL Solutions Inc 'A'	544
Verra Mobility Corp – Class A	11	Amplifon SpA	488
Illumina Inc	10	Verra Mobility Corp – Class A	457
Croda International PLC	10	Planet Fitness Inc – Class A	371
Emirates Central Cooling Systems Corp	10	Illumina Inc	347
Planet Fitness Inc – Class A	10	Croda International PLC	344
Vistry Group PLC	10	Emirates Central Cooling Systems Corp	340
Exponent Inc	9	Vistry Group PLC	334
MIPS AB	9	MIPS AB	325
		Exponent Inc	292
		Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	279
		Mears Group PLC	207
		Coursera Inc	189

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

Franklin Responsible Income 2028 Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 2,400 %, fällig 24.09.2028	3.958	BNP Paribas SA, 0,500 %, fällig 19.02.2028	1.654
Cencora Inc, 2,875 %, fällig 22.05.2028	1.501	NatWest Markets PLC EMTN, 4,250 %, fällig 13.01.2028	1.555
Spanien, Staatsanleihe, 144A, 5,150 %, fällig 31.10.2028	1.088	Intesa Sanpaolo SpA, 1,750 %, fällig 20.03.2028	1.474
Prismian SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028	1.006	OP Corporate Bank plc, 0,375 %, fällig 16.06.2028	1.417
Swedbank AB, Series gmt, 4,250 %, fällig 11.07.2028	830	JPMorgan Chase & Co EMTN, 1,638 %, fällig 18.05.2028	1.373
DSV Finance BV, 3,125 %, fällig 06.11.2028	806	Abertis Infraestructuras SA EMTN, 4,125 %, fällig 31.01.2028	1.340
Reckitt Benckiser Treasury Services Plc, 2,625 %, fällig 10.09.2028	300	Santander UK Group Holdings Plc, 3,530 %, fällig 25.08.2028	1.317
Servicios Financieros Carrefour Establecimiento Financiero de Credito SA, 3,500 %, fällig 29.09.2028	300	CEZ AS EMTN, 3,000 %, fällig 05.06.2028	1.292
AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028	299	Motability Operations Group PLC EMTN, 0,125 %, fällig 20.07.2028	1.278
Autostrade per l'Italia SpA, 1,625 %, fällig 25.01.2028	294	Werfen SA/Spain, 4,625 %, fällig 06.06.2028	1.251
Unicaja Banco SA, 7,250 %, fällig 15.11.2027	208	Caixa Geral de Depositos SA EMTN, 5,750 %, fällig 31.10.2028	1.179
Piraeus Bank SA, 3,000 %, fällig 03.12.2028	199	H Lundbeck A.S., 0,875 %, fällig 14.10.2027	1.159
		Deutsche Lufthansa AG EMTN, 3,750 %, fällig 11.02.2028	1.020
		Prismian SpA, 3,625 %, fällig 28.11.2028	701
		Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 2,400 %, fällig 24.09.2028	651
		Bank of Ireland Group Plc, 4,875 %, fällig 16.07.2028	521
		TeamSystem SpA REGS, 6,029 %, fällig 15.02.2028	501
		Abertis France SAS, 1,625 %, fällig 27.11.2027	482
		Italmatch Chemicals SpA, 10,000 %, fällig 06.02.2028	410
		AIB Group Plc, 2,250 %, fällig 04.04.2028	395
		Verisure Holding AB, 9,250 %, fällig 15.10.2027	327
		Carrier Global Corp, 4,125 %, fällig 29.05.2028	311
		iliad SA, 1,875 %, fällig 11.02.2028	289

Franklin Responsible Income 2029 Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
Spanien, Staatsanleihe, 3,500 %, fällig 31.05.2029	1.043	Aroundtown SA, 4,800 %, fällig 16.07.2029	631
Italien, Certificati di Credito del Tesoro/ CCTS-eu, Serie EU, 144A, 2,753 %, fällig 15.04.2029	1.011	NatWest Group PLC EMTN, 4,771 %, fällig 16.02.2029	628
Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 0,000 %, fällig 25.11.2029	900	Banque Federative du Credit Mutuel SA EMTN, 1,875 %, fällig 18.06.2029	565
Booking Holdings Inc, 4,250 %, fällig 15.05.2029	527	Caixa Geral de Depositos SA EMTN, 5,750 %, fällig 31.10.2028	535
Cencora Inc, 2,875 %, fällig 22.05.2028	500	Magnum Icc Finance BV EMTN, 2,750 %, fällig 26.02.2029	499
Deutsche Bank AG, 3,000 %, fällig 16.06.2029	500	BNP Paribas SA, 1,125 %, fällig 17.04.2029	481
Magnum Icc Finance BV EMTN, 2,750 %, fällig 26.02.2029	498	ZF Europe Finance BV EMTN, 4,750 %, fällig 31.01.2029	471
Französische Republik, Staatsanleihe (OAT), Serie OAT, 144A, 0,500 %, fällig 25.05.2029	467	Heimstadten Bostad Treasury BV EMTN, 0,750 %, fällig 06.09.2029	439
Servicios Financieros Carrefour Establecimiento Financiero de Credito SA, 3,500 %, fällig 29.09.2028	300	iliad SA, 5,375 %, fällig 15.02.2029	421
Logicor Financing Sarl, 4,250 %, fällig 18.07.2029	102	Amber Finco PLC REGS, 6,625 %, fällig 15.07.2029	420
Piraeus Bank SA, 3,000 %, fällig 03.12.2028	100	Lloyds Banking Group PLC EMTN, 4,500 %, fällig 11.01.2029	418
		Abertis Infraestructuras SA EMTN, 4,125 %, fällig 07.08.2029	413
		Air France-KLM EMTN, 4,625 %, fällig 23.05.2029	413
		Coty Inc, 5,750 %, fällig 15.09.2028	412
		Deutsche Lufthansa AG EMTN, 3,500 %, fällig 14.07.2029	304
		Aptiv Swiss Holdings Ltd, 1,600 %, fällig 15.09.2028	288
		Santander UK Group Holdings Plc, 0,603 %, fällig 13.09.2029	283
		Valeo SE EMTN, 5,875 %, fällig 12.04.2029	210
		Banca Transilvania SA EMTN, 8,875 %, fällig 27.04.2027	208
		Birkenstock Financing Sarl REGS, 5,250 %, fällig 30.04.2029	203
		United Group BV, 6,286 %, fällig 01.02.2029	200
		La Doria SpA REGS, 6,686 %, fällig 12.11.2029	200
		TeamSystem SpA REGS, 3,500 %, fällig 15.02.2028	200
		Fibercomp SpA, 1,625 %, fällig 18.01.2029	185
		Lorca Telecom Bondco SA, 4,000 %, fällig 18.09.2027	170
		Ayvens SA, 4,875 %, fällig 06.10.2028	106

FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) €	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) €
Telefonica Europe BV, 6,135 %, Ewige Anleihe	108	Banco de Sabadell SA EMTN, 3,500 %, fällig 27.05.2031	102
Alexandrite Monnet UK Holdco Plc, 10,500 %, fällig 15.05.2029	108		
Autostrade per l'Italia SpA, 4,750 %, fällig 24.01.2031	107		
Benteler International AG, 7,250 %, fällig 15.06.2031	107		
Piraeus Bank SA, 5,375 %, fällig 18.09.2035	106		
Unicaja Banco SA, 5,500 %, fällig 22.06.2034	106		
Rumänien, Internationale Staatsanleihe, 5,375 %, fällig 22.03.2031	106		
Nexans SA, 4,250 %, fällig 11.03.2030	104		
SNF Group SACA, 4,500 %, fällig 15.03.2032	104		
Prismian SpA, 3,875 %, fällig 28.11.2031	103		
Carnival Plc, 4,125 %, fällig 15.07.2031	103		
OTP Bank Nyrt, 4,250 %, fällig 16.10.2030	103		
Getlink SE, 4,125 %, fällig 15.04.2030	103		
Iren SpA, 4,500 %, Ewige Anleihe	103		
New Immo Holding SA, 4,875 %, fällig 08.12.2028	103		
EDP SA, 4,500 %, fällig 27.05.2055	102		
Kapla Holding SAS, 5,000 %, fällig 30.04.2031	102		
Elfenbeinküste, internationale Staatsanleihe, 5,250 %, fällig 22.03.2030	102		
Ibercaja Banco SA, 4,125 %, fällig 18.08.2036	102		
Banco de Sabadell SA EMTN, 3,500 %, fällig 27.05.2031	102		
doValue SpA, 5,375 %, fällig 15.11.2031	102		
Edenred SE, 3,625 %, fällig 13.06.2031	101		
Dynamo Newco II GmbH, 6,250 %, fällig 15.10.2031	101		
Jyske Bank A/S, 3,500 %, fällig 19.11.2031	101		

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Franklin Responsible Income 2031 Fund[^] – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$
Nykredit Realkredit A/S, 3,500 %, fällig 10.07.2031	101
Banca Commerciale Romana SA, 4,000 %, fällig 25.11.2031	101
Nexi SpA, 3,875 %, fällig 21.05.2031	101
Energo – Pro as, 6,450 %, fällig 15.04.2031	100
Electricité de France SA, 4,375 %, ohne Laufzeitbegrenzung	100
Erste Group Bank AG, 3,625 %, fällig 26.11.2035	100
Mundys SpA, 3,700 %, fällig 29.09.2031	100
Sunrise HoldCo IV BV, 3,875 %, fällig 15.06.2029	100
Holding d'Infrastructures des Metiers de l'Environnement SAS, 3,875 %, fällig 31.01.2031	100
Warehouses De Pauw CVA, 3,125 %, fällig 15.01.2031	100
Iberdrola Finanzas SA, 3,750 %, Ewige Anleihe	100
Volkswagen International Finance NV, 4,375 %, Ewige Anleihe	100
North Macedonia Government International Bond, 3,875 %, fällig 21.01.2030	100
Goldstory SAS, 6,750 %, fällig 01.02.2030	99
IQVIA Inc, 2,875 %, fällig 15.06.2028	99
SoftBank Group Corp, 5,750 %, fällig 08.07.2032	99
Novelis Sheet Ingot GmbH, 3,375 %, fällig 15.04.2029	99
WMG Acquisition Corp, 2,250 %, fällig 15.08.2031	96
IPD 3 BV, 5,500 %, fällig 15.06.2031	95
Vmed O2 UK Financing I Plc, 3,250 %, fällig 31.01.2031	94
Engie SA, 1,875 %, Ewige Anleihe	92
X3G Mergeco SpA, 7,000 %, fällig 15.05.2030	91
CTP NV, 1,500 %, fällig 27.09.2031	90
Ziggo Bond Co BV, 3,375 %, fällig 28.02.2030	90
Chile, Internationale Staatsanleihe, 0,830 %, fällig 02.07.2031	89
CPI Property Group SA, 1,500 %, fällig 27.01.2031	85

FTGF Franklin Ultra Short Duration Income Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	84.300	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	84.276
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.08.2025	49.582	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.08.2025	49.600
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.08.2025	30.696	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 15.08.2025	30.700
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.08.2025	23.497	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.08.2025	23.500
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.08.2025	17.498	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.08.2025	17.500
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 20.01.2026	14.114	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 20.01.2026	14.120
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.01.2026	14.113	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.01.2026	14.115
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.12.2025	14.028	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.12.2025	14.030
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 26.01.2026	13.975	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 26.01.2026	13.980
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 29.01.2026	13.958	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 29.01.2026	13.960
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 22.10.2025	13.928	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 22.10.2025	13.930
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 27.01.2026	13.888	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 27.01.2026	13.890
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 15.01.2026	13.823	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 15.01.2026	13.825
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 28.01.2026	13.798	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 28.01.2026	13.800
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.10.2025	13.738	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 16.10.2025	13.740
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 15.12.2025	13.685	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 15.12.2025	13.690
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 10.12.2025	13.678	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 10.12.2025	13.680
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 21.10.2025	13.668	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 21.10.2025	13.670
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 11.12.2025	13.653	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 11.12.2025	13.655
Autonation Inc, 0,000 %, fällig 12.12.2025	13.648	Autonation Inc, 0,000 %, fällig 12.12.2025	13.650

FTGF Franklin Global High Yield Bond Fund[^]

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAFF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	16.702	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	15.638
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.04.2025	825	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.04.2025	825
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 02.10.2025	520	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 02.10.2025	524
Gruppo San Donato SPA, 6,500 %, fällig 31.10.2031	416	Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig 28.01.2031	386
RR Donnelley & Sons Co, 144A, 9,500 %, fällig 01.08.2029	374	Dufry One BV, 3,375 %, fällig 15.04.2028	230
Petroleos Mexicanos, 5,950 %, fällig 28.01.2031	332	Commerzbank AG, 6,125 %, Ewige Anleihe	230
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV, 4,375 %, fällig 09.05.2030	329	Deutsche Bank AG, Series 2020, 6,000 %, Ewige Anleihe	200
Dynamo Newco II GmbH, 6,250 %, fällig 15.10.2031	295	United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 22.04.2025	200
CPI Property Group SA, 1,500 %, fällig 27.01.2031	286	White Cap Buyer LLC, 144A, 6,875 %, fällig 15.10.2028	190
United States Treasury Bill, Nullkupon, fällig 16.07.2026	276	Carnival Corp 144A, 5,750 %, fällig 01.03.2027	167
Gatwick Airport Finance Plc, 6,000 %, fällig 21.11.2030	263	CSC Holdings LLC, 144A, 5,375 %, fällig 01.02.2028	164
PRA Group Inc, 144A, 8,875 %, fällig 31.01.2030	258	Snap Inc, 144A, 6,875 %, fällig 01.03.2033	152
Benteler International AG, 7,250 %, fällig 15.06.2031	240	Wynn Resorts Finance LLC / Wynn Resorts Capital Corp 144A, 5,125 %, fällig 01.10.2029	148
Shift4 Payments LLC / Shift4 Payments Finance Sub Inc, 5,500 %, fällig 15.05.2033	239	Kier Group Plc, 9,000 %, fällig 15.02.2029	142
Jane Street Group / JSG Finance Inc, 144A, 6,125 %, fällig 01.11.2032	239	PRA Group Inc, 144A, 8,875 %, fällig 31.01.2030	138
FIS Fabbria Italiana Sintetici SpA, 5,279 %, fällig 05.02.2031	238	Air France-KLM, 8,125 %, fällig 31.05.2028	132
Mundys SpA, 3,700 %, fällig 29.09.2031	233	Intelligent Packaging Ltd Finco Inc / Intelligent Packaging Ltd Co-Issuer LLC	
Constellium SE, 3,125 %, fällig 15.07.2029	220	144A, 6,000 %, fällig 15.09.2028	130
Dufry One BV, 3,375 %, fällig 15.04.2028	220	Telefonica Europe BV, 7,125 %, Ewige Anleihe	128
Commerzbank AG, 6,125 %, Ewige Anleihe	220	Benteler International Austria GmbH REGS, 9,375 %, fällig 15.05.2028	124
		Assemblin Caverion Group AB, 6,250 %, fällig 01.07.2030	123

[^] In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Putnam US Large Cap Growth Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	18.554	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	16.555
Apple Inc	6.994	Amazon.com Inc	1.605
Microsoft Corp	6.796	Netflix Inc	1.231
NVIDIA Corp	5.547	AppLovin Corp 'A'	1.129
Alphabet Inc	4.222	Alphabet Inc	1.099
Amazon.com Inc	4.133	Oracle Corp	926
Meta Platforms Inc 'A'	4.031	Apple Inc	920
Broadcom Inc	3.904	NVIDIA Corp	911
Tesla Inc	2.900	Salesforce Inc	888
Eli Lilly & Co	2.726	Invesco EQQQ Nasdaq-100 UCITS ETF – ETF	839
Mastercard Inc	2.718	Meta Platforms Inc 'A'	827
Invesco EQQQ Nasdaq-100 UCITS ETF – ETF	2.600	Shopify Inc – Class A	808
Visa Inc 'A'	2.168	Eli Lilly & Co	752
Netflix Inc	1.796	DoorDash Inc	640
Advanced Micro Devices Inc	1.625	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 07.04.2025	636
Costco Wholesale Corp	1.573	Mastercard Inc	633
AbbVie Inc	1.510	Broadcom Inc	632
GE Vernova Inc	1.418	General Electric Co	631
Oracle Corp	1.377	Visa Inc 'A'	622
Lam Research Corp	1.347	Microsoft Corp	608
Cadence Design Systems Inc	1.337	Waste Connections Inc	591
ServiceNow Inc	1.306	Progressive Corp/The	516
Trane Technologies Plc	1.259	Chipotle Mexican Grill Inc 'A'	486
Arista Networks Inc	1.105	CoStar Group Inc	482
		Tesla Inc	447
		Spotify Technology SA	437
		S&P Global Inc	436

FTGF Putnam US Large Cap Value Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	194.549	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	154.982
Citigroup Inc	25.441	Walmart Inc	11.867
Alphabet Inc 'A'	22.620	Alphabet Inc 'A'	10.049
Cisco Systems Inc	20.146	Citigroup Inc	9.808
Microsoft Corp	19.768	Johnson Controls International plc	7.211
Exxon Mobil Corp	17.902	Cisco Systems Inc	7.076
Philip Morris International Inc	17.603	Exxon Mobil Corp	6.653
Amazon.com Inc	17.422	Seagate Technology Holdings Plc	6.332
Walmart Inc	16.943	General Motors Co	6.205
Coca-Cola Co/The	16.541	Bank of America Corp	6.187
Bank of America Corp	16.467	RTX Corp	6.145
Capital One Financial Corp	16.210	Amazon.com Inc	6.144
NextEra Energy Inc	15.914	Philip Morris International Inc	6.081
McKesson Corp	15.148	Coca-Cola Co/The	6.034
General Motors Co	14.728	NextEra Energy Inc	5.994
PulteGroup Inc	13.956	McKesson Corp	5.932
Thermo Fisher Scientific Inc	13.790	Microsoft Corp	5.867
Honeywell International Inc	12.998	Capital One Financial Corp	5.764
RTX Corp	12.601	Thermo Fisher Scientific Inc	5.203
Charles Schwab Corp/The	12.299	PulteGroup Inc	5.188
Accenture Plc 'A'	12.179	Regeneron Pharmaceuticals Inc	4.430
Procter & Gamble Co/The	11.835	Charles Schwab Corp/The	4.305
Regeneron Pharmaceuticals Inc	11.214		
Corteva Inc	10.573		
Southwest Airlines Co	10.550		
T-Mobile US Inc	10.391		
CRH Plc	10.300		
FedEx Corp	10.145		
UnitedHealth Group Inc	10.058		
PNC Financial Services Group Inc/The	9.976		
Johnson Controls International plc	9.879		
Allstate Corp/The	9.876		
Northrop Grumman Corp	9.797		
CME Group Inc	9.468		
Goldman Sachs Group Inc/The	9.244		
Freemport-McMoRan Inc	9.216		
Sanofi SA	9.108		

FTGF Putnam Balanced Fund^

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF- FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE (in Tsd.) \$
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.02.2026	21.100	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.02.2026	21.102
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.02.2026	18.687	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 25.02.2026	18.689
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 19.02.2026	17.941	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 19.02.2026	17.943
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.02.2026	17.575	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 18.02.2026	17.577
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 27.02.2026	17.438	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 27.02.2026	17.440
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 24.02.2026	17.394	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 24.02.2026	17.396
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.02.2026	17.262	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 17.02.2026	17.269
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 09.02.2026	17.234	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 09.02.2026	17.239
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.02.2026	17.179	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 11.02.2026	17.181
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 23.02.2026	17.067	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 23.02.2026	17.072

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

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

FTGF Putnam Balanced Fund^ – (Fortsetzung)

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF-	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE
	FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		(in Tsd.) \$
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.02.2026	16.860	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 10.02.2026	16.862
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.02.2026	16.082	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 26.02.2026	16.084
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.02.2026	16.024	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 13.02.2026	16.026
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 03.02.2026	15.553	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 03.02.2026	15.555
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 30.01.2026	14.436	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 30.01.2026	14.437
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 02.02.2026	14.403	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 02.02.2026	14.407
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.02.2026	13.959	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 06.02.2026	13.960
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.02.2026	13.407	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 05.02.2026	13.408
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.02.2026	13.107	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 12.02.2026	13.108
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 29.01.2026	12.974	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 29.01.2026	12.975
Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 04.02.2026	12.736	Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 04.02.2026	12.737
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 28.01.2026	12.329
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 20.01.2026	12.233
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 27.01.2026	11.099
		Federal Home Loan Bank Discount Notes, Nullkupon, fällig 22.01.2026	10.877

FTGF Putnam Global Healthcare Fund

WICHTIGSTE KÄUFE	ANSCHAF-	WICHTIGSTE VERKÄUFE	ERLÖSE
	FUNGSKOSTEN (in Tsd.) \$		(in Tsd.) \$
JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	1.115	JPMorgan Liquidity Funds – USD Liquidity LVNAV Fund	939
Eli Lilly & Co	379	Innoviva Inc	186
UnitedHealth Group Inc	295	Eli Lilly & Co	149
Johnson & Johnson	256	Novo Nordisk A/S	105
AbbVie Inc	236	UnitedHealth Group Inc	103
Novo Nordisk A/S	228	Medtronic Plc	92
Intuitive Surgical Inc	221	Roche Holding AG	91
Merck & Co Inc	216	Ascendis Pharma A/S ADR	91
AstraZeneca Plc	210	Abbott Laboratories	88
Boston Scientific Corp	202	Sanofi SA	79
Roche Holding AG	189	Merck & Co Inc	79
Medtronic Plc	183	AstraZeneca Plc	78
Innoviva Inc	173	Regeneron Pharmaceuticals Inc	68
Sanofi SA	168	Becton Dickinson & Co	64
Thermo Fisher Scientific Inc	168	McKesson Corp	63
Novartis AG	155	Danaher Corp	60
Abbott Laboratories	141	Thermo Fisher Scientific Inc	58
McKesson Corp	137	Boston Scientific Corp	53
Ascendis Pharma A/S ADR	128	Intuitive Surgical Inc	52
Vertex Pharmaceuticals Inc	111	AbbVie Inc	49
Gilead Sciences Inc	107	Cigna Group/The	46
Becton Dickinson & Co	100	Humana Inc	44
Regeneron Pharmaceuticals Inc	93	EssilorLuxottica SA	42
Cardinal Health Inc	80	IQVIA Holdings Inc	37
CVS Health Corp	75	Verona Pharma PLC	37
Bristol-Myers Squibb Co	71	Gilead Sciences Inc	37
HCA Healthcare Inc	69	Galderma Group AG	36
		Takeda Pharmaceutical Co Ltd	36

^ In Hongkong nicht zum öffentlichen Vertrieb zugelassen.

Vergütungspolitik gemäß OGAW-V (ungeprüft)

Vergütung

Franklin Templeton International Services S.à.r.l. („FTIS“), eine für OGAW zugelassene Verwaltungsgesellschaft (die „Verwaltungsgesellschaft“), wendet eine Vergütungsrichtlinie (die „Richtlinie“) an, die für alle von ihr verwalteten OGAW-Fonds (jeweils ein „OGAW“ und gemeinsam die „OGAW“) gilt. Die Richtlinie ist darauf ausgerichtet, das Eingehen übermäßiger Risiken zu verhindern. Die entsprechenden Performance-Managementsysteme umfassen Risikokriterien, die für die hiervon abgedeckten Geschäftsbereiche spezifisch sind. Die Governance-Struktur der Richtlinie zielt darauf ab, interne Interessenkonflikte zu verhindern.

Es gibt definierte Verfahren für die Erstellung, Aktualisierung, Überprüfung und Genehmigung der Richtlinie sowie für die Kommunikation und Umsetzung der Richtlinie. Sowohl die Geschäftsleitung als auch die Personalabteilung, die Compliance-Beauftragten und andere Abteilungen sind in dieses Verfahren eingebunden. Die Richtlinie wird von der Geschäftsführung und vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft genehmigt.

Die feste Vergütung ist definiert als Grundgehalt zuzüglich sonstiger Leistungen, zu denen Pensionsbeiträge, Lebensversicherungsprämien oder Beiträge zur privaten Krankenversicherung zählen können. Die Höhe der festen Vergütung wird in Abhängigkeit von der Komplexität der Aufgabe, dem Grad der Verantwortung, der Leistung und den Marktvergleichsdaten festgelegt. Sie wird regelmäßig überprüft.

Die variable Vergütung ist definiert als jährliche Boni, langfristige Zusagen in Form von gewährten Performance-Anteilen oder Vertriebsbonuszahlungen. Die Höhe der variablen Vergütung richtet sich nach dem Gesamtergebnis des Unternehmens und des Geschäftsbereichs sowie nach der individuellen Leistung.

Die vollständige Richtlinie ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich. Quantitative Informationen, die für die Fonds relevant sind, sind nachfolgend aufgeführt:

Gesamtbetrag der festen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2025 gezahlt wurde*, **, ***	7.614.692 €
Gesamtbetrag der variablen Vergütung, die von FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2025 gezahlt wurde*, **, ***	7.503.165 €
Anzahl der Mitarbeiter von FTIS und seinen Beauftragten zum 30. September 2025	508
Gesamtbetrag der Vergütung, die FTIS und seinen Beauftragten während des Geschäftsjahres zum 30. September 2025 an die Geschäftsleitung gezahlt haben*, **, ***	4.401.983 €
Von FTIS und seinen Beauftragten an andere Mitarbeiter, die während des Geschäftsjahres zum 30. September 2025 erheblichen Einfluss auf das OGAW-Profil hatten, gezahlter Gesamtbetrag*, **, ***	– €

* Der Gesamtbetrag der von FTIS gezahlten Vergütung wurde den einzelnen OGAW auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2025 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

** Der Gesamtbetrag der von den Beauftragten von FTIS gezahlten Vergütung wurde den einzelnen OGAW auf der Grundlage ihres anteiligen Anteils am durchschnittlichen Nettovermögen von den Beauftragten von FTIS am Monatsende für das am 30. September 2025 zu Ende gegangene Jahr zugewiesen.

*** Bei den Beauftragten handelt es sich um Anlageverwaltungsgesellschaften, die aufsichtsrechtlichen Anforderungen unterliegen, die ebenso wirksam sind wie die des Artikels 69-3(a) der OGAW-Richtlinie.

Anhang: EU-Verordnung zur Erhöhung der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTR-Verordnung) (ungeprüft)

In den folgenden Tabellen sind der Bruttogesamtnennwert für Reverse-Repo-Geschäfte sowie der absolute Marktwert als Anteil des Nettoinventarwerts jedes Fonds, analysiert nach Kontrahenten, zum 28. Februar 2026 aufgeführt:

Reverse-Repo-Geschäfte

FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund

Gegenpartei	Gründungsland	Summe Brutto-Nominalwert (in Tsd.) USD	Absoluter beizulegender Zeitwert (in Tsd.) USD	% vom Nettoinventarwert
Canadian Imperial Bank of Commerce	Kanada	175.000	175.000	8,46 %
HSBC Bank (USA)	Vereinigtes Königreich	140.000	140.000	6,77 %
JP Morgan Securities LLC	USA	150.000	150.000	7,26 %
Royal Bank of Canada	Kanada	50.000	50.000	2,42 %
TD Securities (USA) LLC	Kanada	111.087	111.087	5,37 %
		626.087	626.087	30,28 %

In der folgenden Tabelle sind die zehn größten Emittenten von Sicherheiten aufgeführt, basierend auf dem Wert der erhaltenen unbaren Sicherheiten und der Währung der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 28. Februar 2026:

Fonds	Emittent der Sicherheit*	Währung	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	USA***	US-Dollar	638.753 \$

* Sofern es am Ende des Geschäftsjahres weniger als zehn Emittenten von Sicherheiten gab, wurden alle Emittenten einbezogen.

** Die zugrundeliegende Anleihe, die als Sicherheit gehalten wird, wird vom United States Treasury ausgegeben.

Die folgende Tabelle enthält eine Analyse der Art und Qualität der erhaltenen unbaren Sicherheiten zum 28. Februar 2026:

Fonds	Art der Sicherheit	Qualität der Sicherheit	Gesamtwert der gehaltenen Sicherheiten (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Staatsanleihen und Schuldverschreibungen	Investment Grade	638.753 \$

Die nachstehende Laufzeitanalyse basiert auf dem vertraglichen Fälligkeitsdatum der Reverse-Repo-Geschäfte und den damit verbundenen erhaltenen.(bereitgestellten) Sicherheiten zum 28. Februar 2026:

Fonds	Art des Derivats.der Sicherheit	Weniger als 1 Tag (in Tsd.)	1 Tag bis 1 Woche (in Tsd.)	1 Woche bis 1 Monat (in Tsd.)	1 Monat bis 3 Monate (in Tsd.)	3 Monate bis 1 Jahr (in Tsd.)	Über 1 Jahr (in Tsd.)	Ohne Fälligkeitsdatum (in Tsd.)	Gesamt (in Tsd.)
FTGF Western Asset US Government Liquidity Fund	Reverse-Repo-Geschäfte	—	626.087 \$	—	—	—	—	—	626.087 \$
	Erhaltene unbare Sicherheiten	—	—	—	30.981 \$	56.639 \$	551.133 \$	—	638.753 \$

Bei den Reverse-Repo-Geschäften, die für den Legg Mason Western Asset US Government Liquidity Fund gehalten werden, handelt es sich um Dreiparteienverträge. Vom Fonds im Zusammenhang mit den zum 28. Februar 2026 offenen Reverse-Repo-Geschäften vereinnahmte Sicherheiten werden bei der Bank of New York Mellon auf getrennten Konten im Namen der Gesellschaft gehalten. Erhaltene Sicherheiten werden nicht weiterverwendet.

Alle Kosten und Renditen aus Reverse-Repo-Geschäften laufen in voller Höhe für den Fonds auf.

Anhang: Offenlegung von Geschäften mit verbundenen Personen (ungeprüft)

In dem am 28. Februar 2026 endenden Geschäftsjahr erbrachte Pershing Limited, eine Tochtergesellschaft von The Bank of New York Mellon Corporation und eine verbundene Person der Verwahrstelle, Brokerage-Dienstleistungen in Bezug auf den Wertpapierhandel mit den in Hongkong registrierten Fonds, der über die Untereinlageverwalter der jeweiligen Fonds abgewickelt wird. Der Gesamtwert der Geschäfte mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen in Bezug auf den Wertpapierhandel belief sich auf 334 Mio. USD, was 0,09 % des Gesamtwerts der von diesen Fonds abgeschlossenen Transaktionen entspricht. Die von den Fonds an Pershing Limited gezahlten Maklergebühren und -provisionen im Zusammenhang mit diesem Wertpapierhandel beliefen sich für das am 28. Februar 2026 endende Geschäftsjahr auf 62.191 USD bei einem durchschnittlichen Provisionssatz von 2 Basispunkten. Diese sind in den Transaktionskosten für Käufe und Verkäufe relevanter Wertpapiere enthalten und in Erläuterung 4 dieses Abschlusses ausgewiesen.

In dem am 28. Februar 2026 endenden Geschäftsjahr handelten The Bank of New York Mellon (Institutional Bank) und The Bank of New York Mellon SA/NV, beide verbundene Personen der Verwahrstelle, im Rahmen von Devisengeschäften bzw. Währungsmanagement-/Absicherungsprogrammen für die in Hongkong registrierten Fonds. Die im Zusammenhang mit diesen Transaktionen gezahlten Provisionen beliefen sich auf 788.998 USD bei einem durchschnittlichen Provisionssatz von 0,23 Basispunkten. Der Gesamtwert der diesbezüglichen Geschäfte mit den mit der Verwahrstelle verbundenen Personen belief sich auf 34.896 Mio. USD, was 7,86 % des Gesamtwerts der von den Fonds abgeschlossenen Geschäfte entspricht.

Alle Geschäfte mit den verbundenen Personen der Verwahrstelle wurden im ordentlichen Geschäftsgang und zu marktüblichen Bedingungen geschlossen.

Anhang: Sustainability Finance Disclosure Regulation (ungeprüft)

Die Sustainable Finance Disclosure Regulation (Verordnung (EU) 2019/2088) (die „SFDR“) schreibt vor, dass die Gesellschaft in ihre regelmäßigen Berichte eine Beschreibung aufnehmen muss, inwieweit jeder nach Artikel 8 SFDR (ein „Artikel-8-Fonds“) oder Artikel 9 SFDR (ein „Artikel-9-Fonds“) eingestufte Fonds seinen ökologischen oder sozialen Merkmalen gerecht wurde. Gemäß SFDR sind zudem die Europäische Bankenaufsicht, die Europäische Aufsichtsbehörde für das Versicherungswesen und die betriebliche Altersversorgung und die Europäische Wertpapieraufsichtsbehörde (zusammen die „europäischen Aufsichtsbehörden“) befugt, Entwürfe für technische Regulierungsstandards („RTS“) auszuarbeiten, die Inhalt und Format der Informationen für die regelmäßigen Berichte vorgeben.

Der folgende Anhang, der die nach der SFDR vorgeschriebenen Angaben für jeden Artikel-8- und Artikel-9-Fonds enthält, wurde unter Anwendung der einheitlichen Vorgaben für Nachhaltigkeitsangaben bzw. die diesbezügliche Berichterstattung gemäß den RTS erstellt. Diese Vorgaben traten am 1. Januar 2023 in Kraft. Die Klassifizierungen der Anlagen in den folgenden Angaben basieren auf dem MSCI und können sich von der Klassifizierung der Wertpapiere im Anlagenportfolio unterscheiden.

FTGF Western Asset US Core Bond Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300WRHLJECFCSP797



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 4,95% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14)

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 4,47 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	134,44	97,50%	121,92	96,00%	109,18	64,62%	121,00	95,90%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	175,99	100,00%	188,33	100,00%	203,33	100,00%	235,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,50%	0,00%	19,72%	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,50%	0,00%	69,22%	0,00%	65,42%	0,00%	95,00%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf eines oder mehrere UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen wesentliche ökologische und/oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe des unternehmenseigenen Research sowie intern entwickelten Instrumenten, darunter auch negatives Screening, Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fonds, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Wo sie Bedenken hatte und wo es relevant war, bemühte sich die Anlageverwaltung um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Fannie Mae Pool	Finanzsektor	11,74%	USA
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Finanzsektor	8,40%	USA
United States Treasury Note/Bond	Staatsanleihen	7,48%	USA
GOVT NATL MORTG ASSN	Agency-Anleihen	5,49%	USA
Western Asset US Dollar Liquidity Fund	Finanzsektor	3,16%	Irland
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION	Agency-Anleihen	2,56%	USA
BANK OF AMERICA CORP	Finanzsektor	1,81%	USA
WELLS FARGO & CO	Finanzsektor	1,53%	USA
Fannie Mae Pool	Agency-Anleihen	1,49%	USA
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION	Finanzsektor	1,28%	USA
U S TREASURY NOTE/BOND I/L	Staatsanleihen	1,26%	USA
Goldman Sachs Group Inc/The	Finanzsektor	1,13%	USA
CITIGROUP INC	Finanzsektor	1,03%	USA
UBS GROUP AG	Finanzsektor	1,00%	Schweiz
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Agency-Anleihen	0,99%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

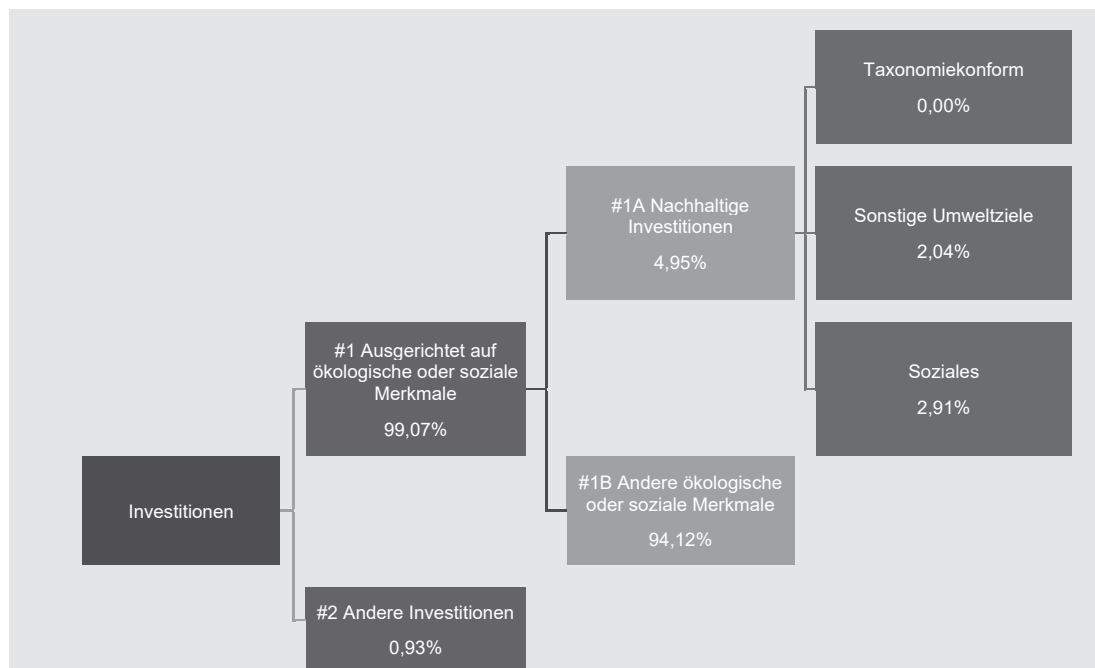
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 4,95 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,07 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,93 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 4,95 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,07%	99,31%	94,20%	92,20%
#2 Andere Investitionen	0,93%	0,69%	5,80%	7,80%
#1A Nachhaltige Investitionen	4,95%	1,37%	3,55%	3,30%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	94,12%	97,94%	90,65%	88,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	2,04%	1,37%	3,55%	3,30%
Soziales	2,91%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	55,60%
Staatsanleihen	22,90%
Energie	4,37%
Gesundheitssektor	4,12%
Kommunikationsdienste	4,06%
Informationstechnologie	2,13%
Zyklische Konsumgüter	1,83%
Versorgungsunternehmen	1,76%
Industrie	1,07%
Immobilien	0,72%
Basiskonsumgüter	0,36%
Grundstoffe	0,14%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	44,51%
Staatsanleihen	22,90%
Banken	6,86%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,37%
Kapitalmärkte	3,76%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,66%
Medien	1,51%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,37%
Pharmaindustrie	1,18%
Stromversorger	1,13%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	0,85%
Biotechnologie	0,75%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,68%
Allgemeiner Einzelhandel	0,68%
Software	0,68%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

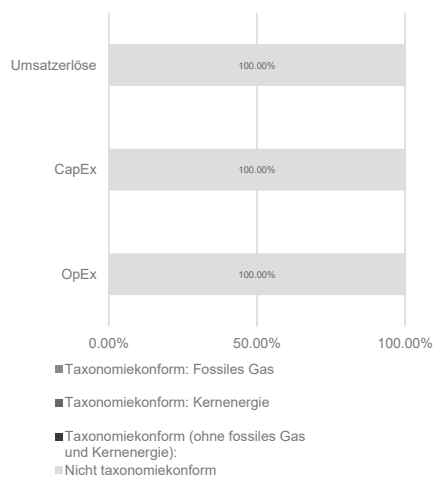
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

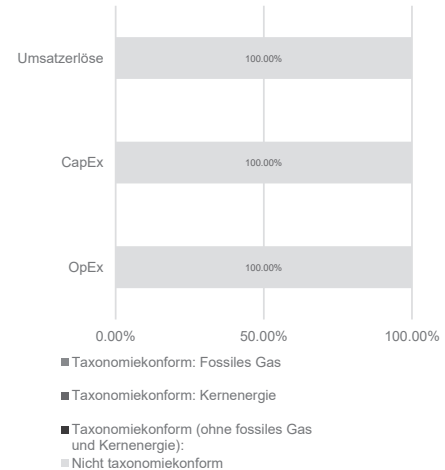
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 2,04 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,93 % und umfasste liquide Mittel und Derivate oder andere Emittenten ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung finanziell wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds versuchte, mindestens 20 % seines Nettovermögens in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem der acht ausgewählten Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN-SDGs) beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,47 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von „A“.
- B. Die WACI des Fonds lag insgesamt bei 72,6 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 30,3 %.
- D. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,47 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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 (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
472PNIHDHJOEBNUD0P21



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 7,05% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 4,99 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	176,13	95,00%	817,96	63,34%	151,54	72,43%	149,90	93,20%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	164,94	100,00%	311,36	18,04%	183,19	100,00%	232,10	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,00%	0,00%	38,08%	0,00%	72,48%	0,00%	92,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,75%	0,00%	62,90%	0,00%	72,52%	0,00%	92,00%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen wesentliche ökologische und/oder sozial nachhaltige Investitionsziele nicht erheblich beeinträchtigten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendet die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entspricht.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fonds, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Finanzsektor	10,91%	USA
Fannie Mae Pool	Finanzsektor	7,63%	USA
GOVT NATL MORTG ASSN	Agency-Anleihen	5,55%	USA
United States Treasury Note/Bond	Staatsanleihen	3,46%	USA
BANK OF AMERICA CORP	Finanzsektor	1,74%	USA
CITIGROUP INC	Finanzsektor	1,66%	USA
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION	Finanzsektor	1,48%	USA
Fannie Mae Pool	Agency-Anleihen	1,32%	USA
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION	Agency-Anleihen	1,26%	USA
JPMORGAN CHASE & CO	Finanzsektor	1,15%	USA
Golub Capital Partners CLO 76 B Ltd Financials 1.11% Jersey Goldman Sachs Group Inc/The	Finanzsektor	1,10%	USA
CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC/CAPITAL	Kommunikationsdienste	0,90%	USA
BANK 2017-BNK7	Finanzsektor	0,88%	USA
Subway Funding LLC	Finanzsektor	0,85%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

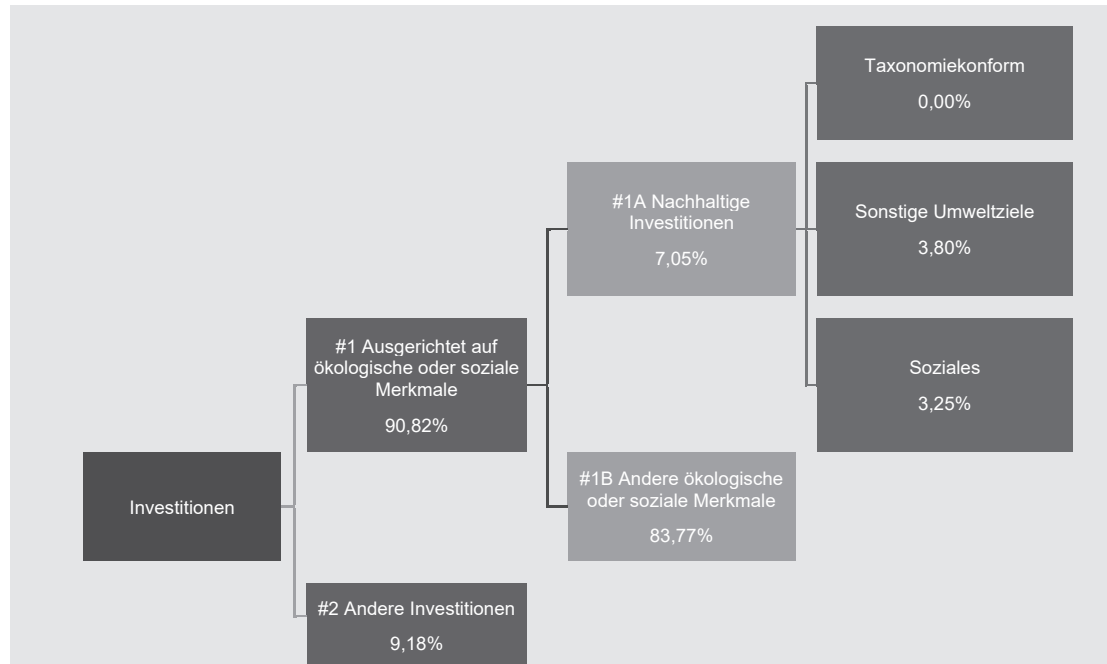
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 7,05 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

90,82 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (9,18 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 7,05 % seines Vermögens 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	90,82%	89,25%	97,77%	95,20%
#2 Andere Investitionen	9,18%	10,75%	2,23%	4,80%
#1A Nachhaltige Investitionen	7,05%	2,42%	3,68%	3,30%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	83,77%	86,83%	94,09%	91,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	3,80%	2,42%	3,68%	3,30%
Soziales	3,25%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	52,19%
Staatsanleihen	16,68%
Kommunikationsdienste	5,14%
Energie	4,11%
Gesundheitssektor	3,76%
Zyklische Konsumgüter	2,42%
Industrie	1,75%
Versorgungsunternehmen	1,51%
Informationstechnologie	1,20%
Immobilien	1,04%
Grundstoffe	0,94%
Basiskonsumgüter	0,09%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	41,02%
Staatsanleihen	16,68%
Banken	6,89%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,98%
Kapitalmärkte	3,30%
Medien	2,35%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	1,59%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,46%
Pharmaindustrie	1,10%
Stromversorger	1,02%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	1,02%
Diversifizierte REITs	0,71%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	0,71%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	0,70%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	0,63%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

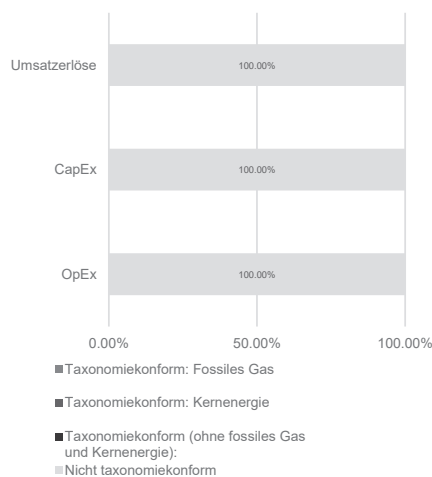
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

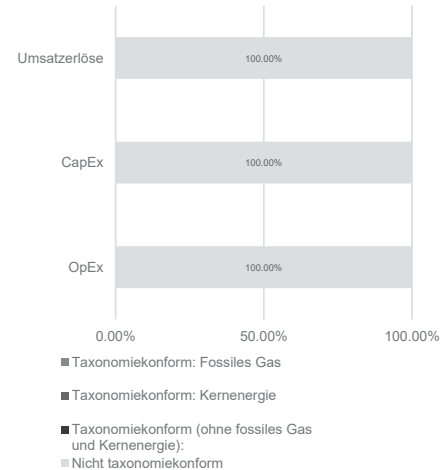
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 3,80 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 9,18 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz, oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds versuchte, mindestens 20 % seines Nettovermögens in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem der acht ausgewählten Ziele der Vereinten Nationen für nachhaltige Entwicklung (UN-SDGs) beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,99 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von „A“.
- B. Die WACI des Fonds lag insgesamt bei 76,2 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 32,5 %.
- D. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,99 % in nachhaltige Anlagen investiert.
- E. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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 (der „Fonds“)

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, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 10,01% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14)

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die nachstehenden Werte – sie bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 7,31 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	137,99	84,75%	1.167,23	41,70%	152,74	48,45%	184,30	80,40%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	185,58	100,00%	375,71	39,20%	211,94	100,00%	245,00	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	92,00%	0,00%	49,53%	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	93,00%	0,00%	43,31%	0,00%	50,04%	0,00%	83,00%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die oben aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
United States Treasury Note/Bond	Staatsanleihen	19,71%	USA
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	Staatsanleihen	4,62%	Deutschland
MEXICAN FIXED RATE BONDS	Staatsanleihen	2,31%	Mexiko
SOUTH AFRICA REPUBLIC OF	Staatsanleihen	2,17%	Südafrika
POLAND GOVERNMENT	Staatsanleihen	1,31%	Polen
Whitbread Group PLC	Zyklische Konsumgüter	1,06%	Vereinigtes Königreich
BANCO SANTANDER SA	Finanzsektor	1,00%	Spanien
NOTA DO TESOURO NACIONAL NTN F	Staatsanleihen	0,97%	Brasilien
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzsektor	0,85%	Vereinigtes Königreich
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	0,84%	Frankreich
Franklin Templeton Qualified Investor Funds II Plc- Western Asset India Bond Fund	Finanzsektor	0,82%	Irland
Greene King Finance PLC	Finanzsektor	0,81%	Vereinigtes Königreich
MARSTONS ISSUER PLC	Finanzsektor	0,78%	Vereinigtes Königreich
BANK OF AMERICA CORP	Finanzsektor	0,73%	USA
CTP NV	Immobilien	0,70%	Niederlande



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

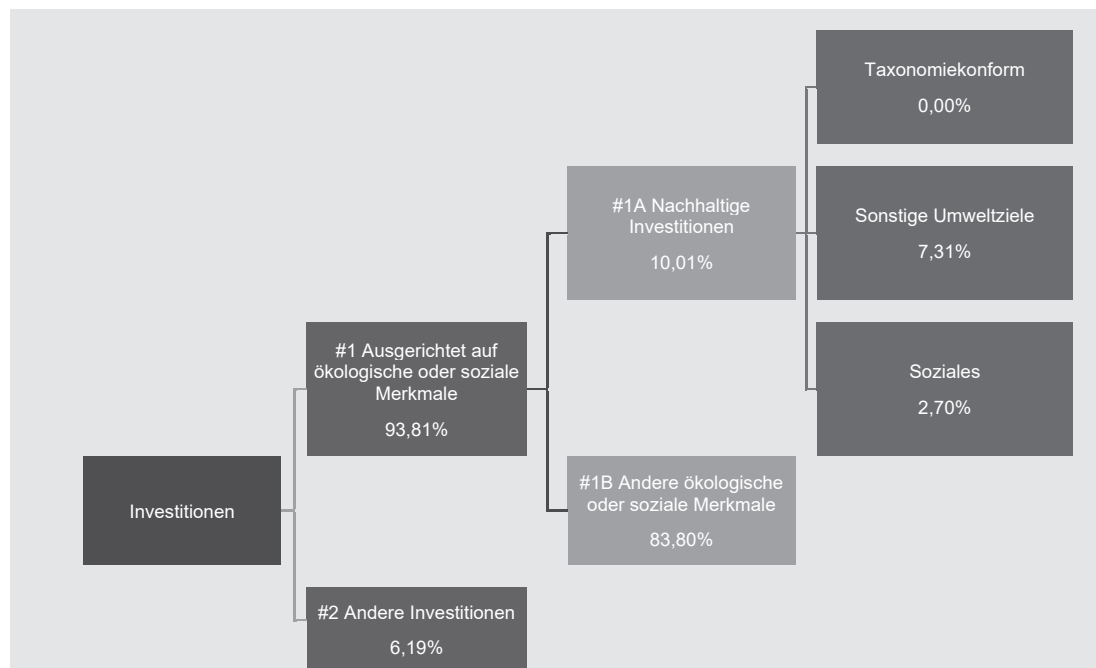
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 10,01 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

93,81 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (6,19 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 10,01 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	93,81%	93,95%	99,25%	85,60%
#2 Andere Investitionen	6,19%	6,05%	0,75%	14,40%
#1A Nachhaltige Investitionen	10,01%	2,76%	4,39%	2,20%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	83,80%	91,19%	94,86%	83,40%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	7,31%	2,76%	4,39%	2,20%
Soziales	2,70%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	35,85%
Finanzsektor	28,40%
Zyklische Konsumgüter	6,67%
Energie	4,68%
Kommunikationsdienste	4,63%
Industrie	4,44%
Informationstechnologie	1,92%
Immobilien	1,78%
Grundstoffe	1,71%
Gesundheitssektor	1,68%
Versorgungsunternehmen	1,38%
Basiskonsumgüter	0,68%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	35,85%
Finanzdienstleistungen	14,71%
Banken	9,94%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	4,20%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,56%
Kapitalmärkte	2,16%
Passagierfluggesellschaften	1,65%
Medien	1,50%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	1,31%
Allgemeiner Einzelhandel	1,29%
Pharmaindustrie	1,27%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,22%
Fahrzeugkomponenten	1,17%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	1,14%
Kommunikationsausrüstung	1,06%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

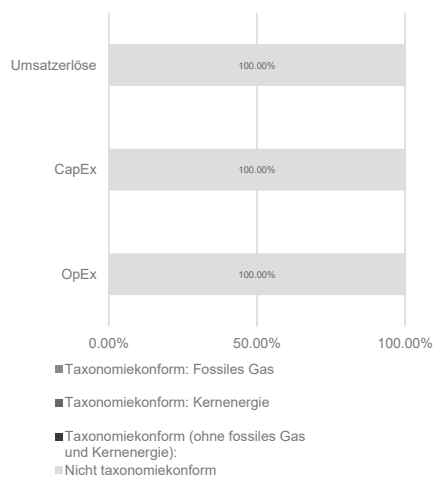
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

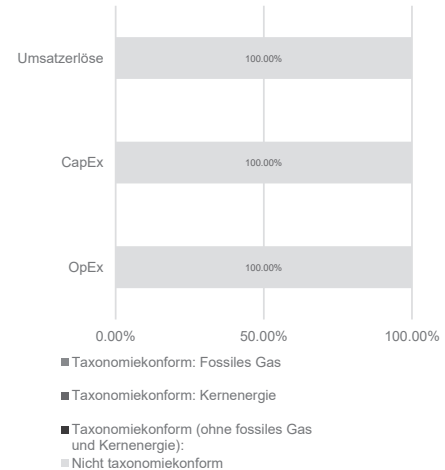
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 7,31 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 6,19 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Fondsportfolios in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 7,31 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von „A“.
- B. Die WACI des Fonds lag bei 79,2 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 35,6 % gemessen am Marktwert.
- 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 (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493005YY2WWVLYH2080



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 4,37% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10),
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14) und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem

Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

– Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab. PAI Nr. 16 war nicht wesentlich, da der Fonds im Berichtsjahr nicht in Staatspapiere investierte.

– Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 2,74 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	174,73	71,50%	160,65	71,00%	189,05	75,09%	230,20	72,90%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	0,00	0,00%	0,00	0,00%	166,84	100,00%	175,30	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	79,75%	0,00%	71,46%	0,00%	73,78%	0,00%	72,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	84,50%	0,00%	68,58%	0,00%	73,78%	0,00%	73,00%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	79,75%	0,00	0,00%	0,00	100,00%	0,00	100,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation von 20 % des Marktwerts in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

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. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

PAI dienten als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Konkret kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten; Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze nicht einhalten; PAI Nr. 14 für Emittenten im gesamten Fonds (gegenüber denjenigen im investierbaren Anlageuniversum), die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen; und PAI Nr. 16 für Länder, in die investiert wird und die von Freedom House nicht als frei bezeichnet werden.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt den Referenzindex zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	Grundstoffe	2,02%	Kanada
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC	Gesundheitssektor	1,77%	USA
Mcclatchy Media Co LLC	Finanzsektor	1,58%	USA
CCO Holdings LLC / CCO Holdings Capital Corp	Kommunikationsdienste	1,57%	USA
DISH DBS CORP	Kommunikationsdienste	1,46%	USA
Venture Global LNG Inc	Energie	1,46%	USA
Western Asset US Dollar Liquidity Fund	Finanzsektor	1,29%	Irland
ECHOSTAR CORP	Kommunikationsdienste	1,23%	USA
CSC HOLDINGS LLC	Kommunikationsdienste	1,21%	USA
Venture Global Plaquemines LNG LLC	Versorgungsunternehmen	1,13%	USA
CARNIVAL CORP	Zyklische Konsumgüter	1,05%	USA
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV	Gesundheitssektor	1,03%	Niederlande
Bausch Health Cos Inc	Gesundheitssektor	1,03%	Kanada
LLOYDS BANKING GROUP PLC	Finanzsektor	1,01%	Vereinigtes Königreich
MICHAELS COS INC/THE	Zyklische Konsumgüter	1,00%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

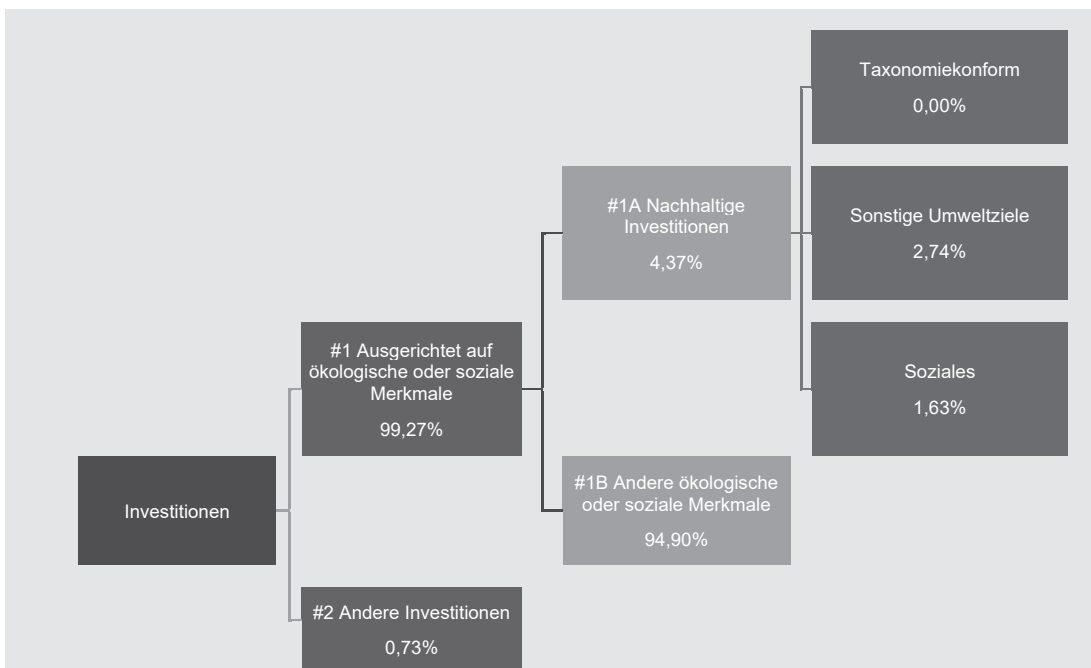
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 4,37 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,27 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,73 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 4,37 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,27%	98,45%	91,20%	89,00%
#2 Andere Investitionen	0,73%	1,55%	8,80%	11,00%
#1A Nachhaltige Investitionen	4,37%	2,03%	3,08%	5,30%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	94,90%	96,42%	88,12%	83,70%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	2,74%	2,03%	3,08%	5,30%
Soziales	1,63%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	25,49%
Zyklische Konsumgüter	15,92%
Industrie	12,16%
Kommunikationsdienste	12,04%
Gesundheitssektor	8,99%
Energie	8,14%
Informationstechnologie	5,48%
Grundstoffe	3,39%
Versorgungsunternehmen	3,08%
Immobilien	2,88%
Basiskonsumgüter	1,22%
Staatsanleihen	0,48%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	16,03%
Medien	8,60%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	7,53%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	6,55%
Banken	5,16%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	4,61%
Fahrzeugkomponenten	3,54%
Pharmaindustrie	3,31%
Fachhandel	2,62%
Metalle u. Bergbau	2,23%
Raumfahrt und Verteidigung	2,03%
Software	2,00%
Kapitalmärkte	1,75%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	1,73%
Passagierfluggesellschaften	1,62%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

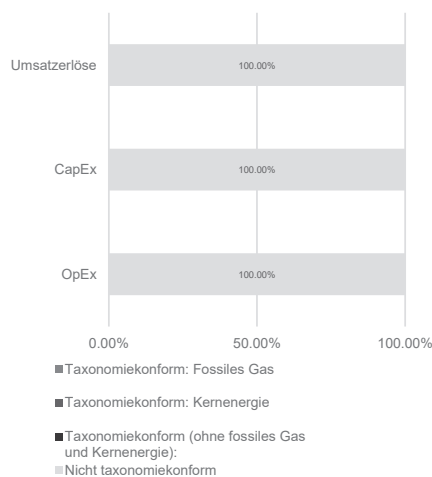
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

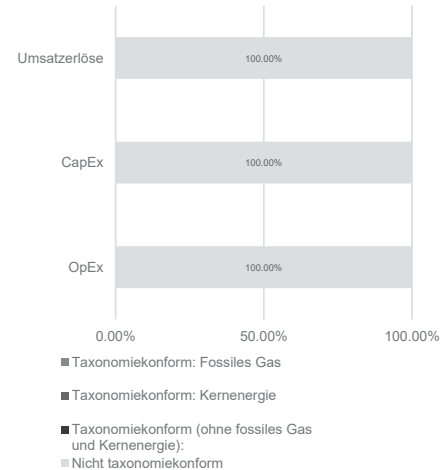
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 2,74 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,73 % und umfasste liquide Mittel und Derivate oder andere Emittenten ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war bestrebt, sich besser als die Benchmark auf Anlagen in Wertpapiere von Emittenten auszurichten, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDGs beitrugen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

e. Bundesstaatliche und/oder staatliche Emittenten, die vom Freedom House Index nicht als „frei“ bezeichnet werden (im Einklang mit PAI-Indikator Nr. 16, Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 2,74 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

A. Die WACI des Fonds lag insgesamt bei 75,9 % der Benchmark.

B. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 28,9 % gemessen am prozentualen Marktwert. C. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

FTGF Western Asset Global High Yield Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493004GEBFENJC57G38



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 7,93% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14)

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 4,79 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	172,71	74,00%	160,71	77,00%	213,05	63,38%	287,10	83,60%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	183,53	100,00%	166,48	100,00%	176,32	100,00%	221,40	95,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	84,00%	0,00%	17,84%	0,00%	64,11%	0,02%	82,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	88,00%	0,00%	63,37%	0,00%	64,11%	0,00%	83,00%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Konkret kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
ECHOSTAR CORP	Kommunikationsdienste	1,94%	USA
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	Grundstoffe	1,88%	Kanada
CARNIVAL PLC	Zyklische Konsumgüter	1,63%	USA
MARSTONS ISSUER PLC	Finanzsektor	1,60%	Vereinigtes Königreich
Türkiye Government International Bond	Staatsanleihen	1,55%	Türkei
CSC HOLDINGS LLC	Kommunikationsdienste	1,48%	USA
INTESA SANPAOLO SPA	Finanzsektor	1,28%	Italien
Venture Global LNG Inc	Energie	1,20%	USA
ALTICE FINANCING SA	Kommunikationsdienste	1,20%	Luxemburg
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS III BV	Gesundheitssektor	1,19%	Niederlande
BBVA Mexico SA Institucion De Banca Multiple Grupo Financiero BBVA Mexico/TX	Finanzsektor	1,17%	USA
CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC/CAPITAL	Kommunikationsdienste	1,16%	USA
CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC	Gesundheitssektor	1,16%	USA
Ivory Coast Government International Bond	Staatsanleihen	1,14%	Cote D'ivoire (Elfenbeinküste)
REPUBLIC OF ARGENTINA	Staatsanleihen	1,10%	Argentinien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

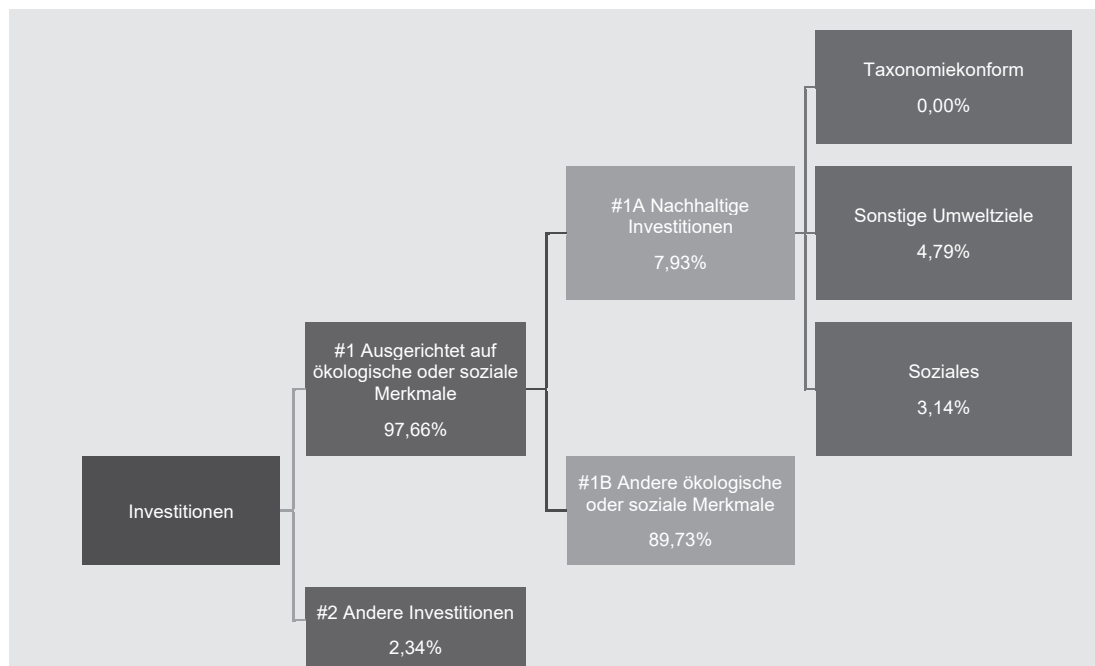
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 7,93 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,66 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,34 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 7,93 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,66%	97,72%	98,66%	85,60%
#2 Andere Investitionen	2,34%	2,28%	1,34%	14,40%
#1A Nachhaltige Investitionen	7,93%	4,07%	7,74%	6,90%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	89,73%	93,65%	90,92%	78,70%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	4,79%	4,07%	7,74%	6,90%
Soziales	3,14%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	20,72%
Zyklische Konsumgüter	15,81%
Staatsanleihen	14,42%
Kommunikationsdienste	12,47%
Industrie	9,61%
Energie	6,76%
Gesundheitssektor	4,84%
Grundstoffe	3,94%
Informationstechnologie	3,85%
Versorgungsunternehmen	1,91%
Immobilien	1,77%
Basiskonsumgüter	1,56%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	14,42%
Finanzdienstleistungen	12,66%
Medien	8,46%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	6,69%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	5,50%
Banken	4,41%
Fahrzeugkomponenten	2,78%
Kapitalmärkte	2,65%
Pharmaindustrie	2,54%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,34%
Allgemeiner Einzelhandel	2,17%
Metalle u. Bergbau	2,06%
Fachhandel	1,84%
Software	1,72%
Bau- u. Ingenieurwesen	1,67%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

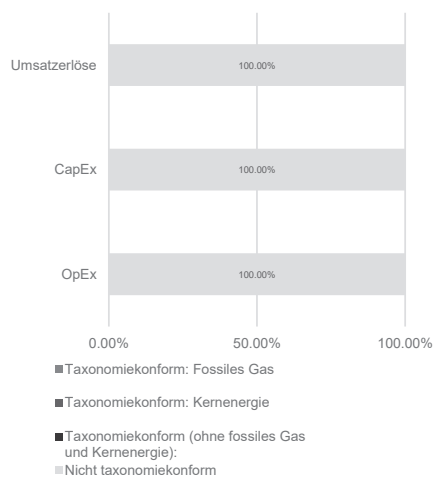
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

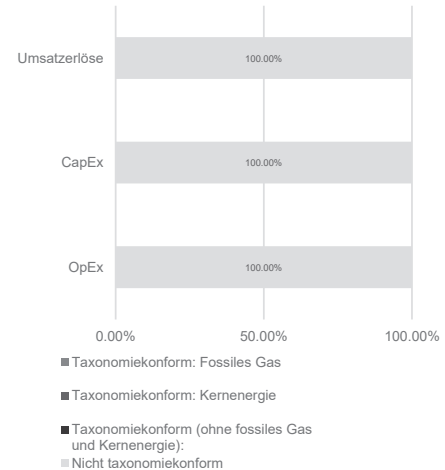
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 4,79 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,34 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz, oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

A. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.

B. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Nettovermögens in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDGs beitrugen.

C. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:

a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.

b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.

c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).

d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,79 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

A. Die WACI des Fonds lag insgesamt bei 69,7 % der Benchmark.

B. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 28,7 % gemessen am prozentualen Marktwert.

C. Der Fonds hatte zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 4,79 % in nachhaltige Anlagen investiert.

D. Die Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Nicht zutreffend.

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

FTGF Western Asset Short Duration Blue Chip Bond Fund (der „Fonds“)

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, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 13,43% an nachhaltigen Investitionen
 - ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10),
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14) und
 - Länder, in denen investiert wird, und die gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem

Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Diese bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 12,16 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	58,49	92,75%	736,53	94,93%	64,03	90,31%	63,20	94,60%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	149,20	100,00%	192,53	0,14%	200,01	100,00%	247,50	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,25%	0,00%	94,52%	0,00%	89,84%	0,00%	95,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,25%	0,00%	93,29%	0,00%	90,09%	0,00%	95,00%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	94,25%	0,00	0,14%	0,00	100,00%	0,00	100,00%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Die Erträge solcher Anleihen wurden für Projekte eingesetzt oder hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI, einschließlich unter anderem:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fonds, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Einhaltung des Prinzips „Do No Significant Harm“ („keinen erheblichen Schaden verursachen“) für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

Konkret kamen die folgenden PAI-Indikatoren zur Anwendung: PAI Nr. 3 für die THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten, Ausschlüsse auf der Grundlage von PAI Nr. 10 für Emittenten, die die UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze nicht einhalten, PAI Nr. 14 für Emittenten im gesamten Fonds (gegenüber denjenigen im investierbaren Anlageuniversum), die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und PAI Nr. 16 für Länder, in die investiert wird und die von Freedom House nicht als frei bezeichnet werden.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt den Referenzindex zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
CREDIT AGRICOLE SA	Finanzsektor	1,85%	Frankreich
Goldman Sachs Group Inc/The	Finanzsektor	1,79%	USA
BNP PARIBAS SA	Finanzsektor	1,74%	Frankreich
MORGAN STANLEY	Finanzsektor	1,62%	USA
BANCO SANTANDER SA	Finanzsektor	1,58%	Spanien
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	Industrie	1,55%	USA
GAS NETWORKS IRELAND	Energie	1,55%	Irland
COMCAST CORP	Kommunikationsdienste	1,50%	USA
Public Storage Operating Co	Immobilien	1,46%	USA
CITIGROUP INC	Finanzsektor	1,46%	USA
Western Asset US Dollar Liquidity Fund	Finanzsektor	1,44%	Irland
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	1,44%	USA
COOPERATIEVE RABOBANK UA	Finanzsektor	1,41%	Niederlande
Aena SME SA	Industrie	1,41%	Spanien
Abbvie Inc	Gesundheitssektor	1,40%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

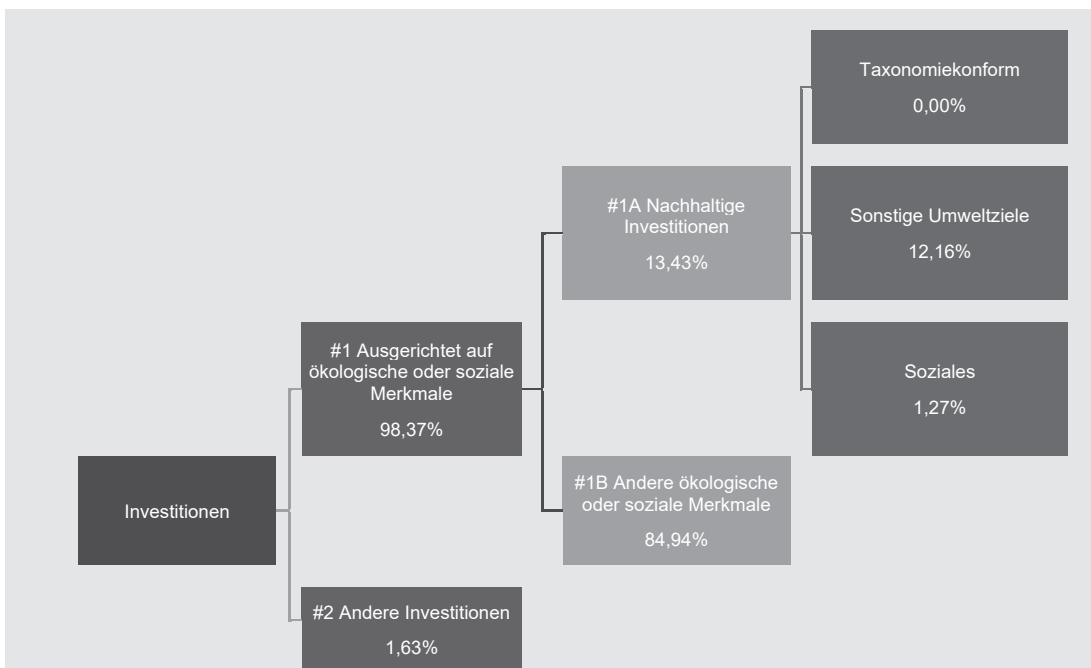
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 13,43 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,37 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,63 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorrangig aus liquiden Mitteln oder Derivaten, für die kein ESG-Rating vorlag.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 13,43 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,37%	98,64%	99,99%	93,50%
#2 Andere Investitionen	1,63%	1,36%	0,01%	6,50%
#1A Nachhaltige Investitionen	13,43%	9,44%	15,65%	12,30%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	84,94%	89,20%	84,34%	81,20%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	12,16%	9,44%	15,65%	12,30%
Soziales	1,27%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	34,00%
Industrie	11,78%
Gesundheitssektor	10,33%
Basiskonsumgüter	10,13%
Immobilien	8,72%
Zyklische Konsumgüter	5,05%
Kommunikationsdienste	5,03%
Versorgungsunternehmen	4,60%
Energie	3,92%
Grundstoffe	2,62%
Informationstechnologie	1,84%
Staatsanleihen	0,35%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	18,78%
Pharmaindustrie	7,06%
Finanzdienstleistungen	6,01%
Kapitalmärkte	5,86%
Stromversorger	4,60%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	4,18%
Getränke	3,81%
Produkte für den persönlichen Bedarf	2,78%
Maschinen	2,62%
Versicherungen	2,52%
Diversifizierte REITs	2,38%
Energieanlagen und -dienstleistungen	2,23%
Bau- u. Ingenieurwesen	2,03%
Verkehrsinfrastruktur	2,02%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,00%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

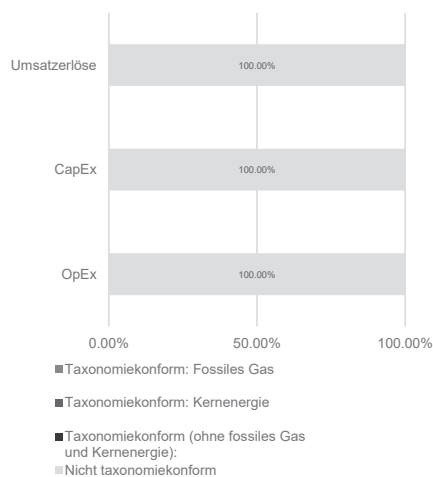
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

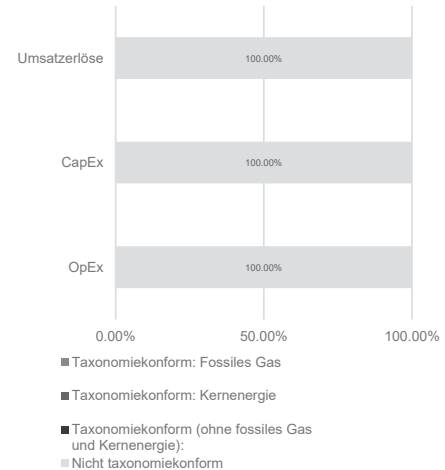
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 12,16 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 1,63 % und umfasste liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, sodass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines Fondsportfolios in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schloss Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstießen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).
 - e. Bundesstaatliche und/oder staatliche Emittenten, die vom Freedom House Index nicht als „frei“ bezeichnet werden, im Einklang mit PAI-Indikator Nr. 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 12,16 % investiert.

Der Fonds bewarb ökologische und/oder nachhaltige Merkmale anhand der oben genannten Leitlinien, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von „A“.
- B. Der WACI des Fonds lag insgesamt bei 30,9 % der Proxy-Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag per 28. Februar 2026 bei 86,2 % des Marktwerts.
- D. Der Fonds hatte keine Anlagen in Emittenten, die gegen die SRI-Leitlinien verstießen.
- E. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF Western Asset Global Bond Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930030VHR7UP4BBZ30



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 6,26% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- Anpassung an eines oder mehrere Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN („SDG“) durch Anlagen in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene (Sustainability-Linked) Anleihen und durch Best-in-Class-Anlagen,
- Anpassung an die folgenden Indikatoren für wesentliche nachteilige Auswirkungen (PAI):
 - THG-Emissionsintensität (PAI Nr. 3 und PAI Nr. 15)
 - Soziales und Beschäftigung (PAI Nr. 10) und
 - Umstrittene Waffen (PAI Nr. 14)

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen

ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Die in der obigen Antwort genannten PAI-Indikatoren. Siehe die nachstehenden Werte – sie bilden die Performance der Indikatoren während des Referenzzeitraums ab.
- Die Allokation in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen lag zum 28. Februar 2026 bei 5,96 %.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	49,41	86,00%	322,38	38,90%	64,51	30,03%	67,50	88,80%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	179,18	100,00%	311,18	49,50%	197,16	100,00%	231,40	100,00%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,00%	0,00%	39,01%	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,25%	0,00%	38,56%	0,00%	30,89%	0,00%	87,00%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Das Ziel der nachhaltigen Investitionen des Fonds war die Reduzierung der THG-Emissionen, gemessen anhand der gewichteten durchschnittlichen Kohlenstoffintensität. Die nachhaltigen Investitionen erfolgten in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen. Sie wurden durch eine Mindestallokation in Emittenten erreicht, die auf die UN-SDGs ausgerichtet sind oder Best-Best-in-Class-Schwellenwerte der Anlageverwaltung erreichten. Diese Anleihen hatten nachhaltigkeitsgebundene KPI oder Einnahmen, die für Projekte verwendet wurden, die unter anderem Folgendes umfassten:

- Grüne Projekte: erneuerbare Energien, Energieeffizienz, Vorbeugung und Kontrolle von Umweltverschmutzung, ökologisch nachhaltiges Management lebender Naturressourcen und der Landnutzung, Artenvielfalt, sauberes Transportwesen, nachhaltiges Wasser- und Abwassermanagement, Anpassung an den Klimawandel, Kreislaufwirtschaft und grüne Gebäude, und
- soziale Projekte: erschwinglicher Wohnraum, erschwingliche Infrastruktur (sauberes Trinkwasser, sanitäre Anlagen), Beschäftigungsprogramme und sozioökonomischer Fortschritt wie vor allem Bildung, Diversität, Gleichberechtigung und Inklusion, um nur einige zu nennen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Die Anlageverwaltung nutzte eigenes Research und PAI-Indikatoren, um sicherzustellen, dass nachhaltige Investitionen keine erheblichen Beeinträchtigungen der ökologischen oder sozial nachhaltigen Anlageziele verursachten. Die Portfoliomanager konnten mithilfe von eigenem Research sowie intern entwickelten Instrumenten wie u. a. Screening-Tools Emittenten identifizieren, die nach Ansicht der Anlageverwaltung keine erheblichen Schäden verursachen.

So konnte die Anlageverwaltung in Emittenten investieren, die mit den PAI-Indikatoren im Einklang standen, und Emittenten vermeiden, bei denen dies nicht der Fall war. Im Rahmen der Investitionen des Fonds in grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen wendete die Anlageverwaltung diesen Ansatz zur Feststellung an, ob eine Anleihe den Nachhaltigkeitskriterien entsprach.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten und/oder Korruption überprüft.

Bei der Zuweisung von Mitteln in nachhaltige Investitionen, vor allem den mindestens 1 % des Fondsportfolios, die für Umweltziele zugesagt sind, führte die Anlageverwaltung (auf der Grundlage des internen Research oder externer Einschätzungen von Dritten) zusätzliche qualitative Bewertungen des Emittenten und der Erfüllung des Kriteriums „Do No Significant Harm“ für das Projekt durch.

Zudem wurden auf den Fonds einige Ausschlusskriterien angewandt, um Emittenten von vornherein auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen (siehe Details weiter unten).

-----**Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

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

PAI dienen als nützliches Barometer zur Einschätzung, welche Emittenten folgende Investitionen anstreben. Genauer betrachtet kamen PAI Nr. 3 für die Bewertung der THG-Emissionsintensität von Unternehmen und PAI Nr. 15 für die THG-Emissionsintensität von Staaten zur Anwendung. PAI Nr. 10 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Leitsätze nicht einhalten. PAI Nr. 14 wurde angewendet, um Emittenten zu ermitteln, die den Kriterien für umstrittene Waffen nicht entsprechen, und zwar im gesamten Fonds im Vergleich zum investierbaren Anlageuniversum.

Der Fonds verpflichtete sich zwar nicht dazu, mit seinem PAI-Durchschnitt die Benchmark zu übertreffen, aber der Unterschied zwischen diesen beiden Messwerten unterstützte die Einschätzung, wie erfolgreich der Fonds nachteilige Auswirkungen steuerte.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Der Fonds hielt sich an ausdrückliche Leitlinien zu Emittenten, die die UNGC-Prinzipien und die OECD-Richtlinien nicht einhielten, indem er diese Emittenten ausschloss. Zusätzlich baute das Engagement der Anlageverwaltung in Emittenten auf den Prinzipien des UNGC und den OECD-Richtlinien auf. Emittenten, bei denen eine Nichteinhaltung des UNGC festgestellt wurde, wurden auf eine „Rote Liste ESG“ gesetzt. Emittenten in dieser Liste wurden von Investitionen des Fonds ausgeschlossen. Die Anlageverwaltung bemühte sich dort, wo es relevant war, um eine aktive Kontaktaufnahme mit Emittenten, bei denen Bedenken bestanden, und die (eventuell noch nicht ausdrücklich) gegen die zugrunde liegenden Leitlinien verstießen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird oben näher erläutert.

Die nachstehend aufgeführten PAI-Kennzahlen basieren auf der Durchschnittsberechnung vierteljährlicher Momentaufnahmen während des Referenzzeitraums. Die Berechnung der relevanten Kennzahlen bezieht sich auf die Anlagen, für die die zugrunde liegenden ESG-Daten verfügbar sind, nicht auf alle vom Fonds gehaltenen Anlagen. Bitte beachten Sie, dass sich diese Informationen jederzeit ändern können und nur Informationszwecken dienen.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Franklin Templeton China Funds-Western Asset China Bond Fund	Finanzsektor	7,05%	Irland
FEDERAL HOME LOAN MORTGAGE CORP	Finanzsektor	6,88%	USA
U K TREASURY NOTE/BOND	Staatsanleihen	5,33%	Vereinigtes Königreich
United States Treasury Note/Bond	Staatsanleihen	4,84%	USA
GOVT NATL MORTG ASSN	Agency-Anleihen	3,59%	USA
JAPAN GOVT (5 YEAR ISSUE)	Staatsanleihen	3,45%	Japan
KOREA TREASURY BOND	Staatsanleihen	2,86%	Südkorea
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	Staatsanleihen	2,40%	Deutschland
NOTA DO TESOURO NACIONAL NTN F	Staatsanleihen	2,09%	Brasilien
GERMANY FEDERAL REPUBLIC OF	Staatsanleihen	1,98%	Deutschland
JAPAN GOVT (30 YEAR ISSUE)	Staatsanleihen	1,95%	Japan
JAPAN GOVT (2 YEAR ISSUE)	Staatsanleihen	1,93%	Japan
Fannie Mae Pool	Finanzsektor	1,90%	USA
FRANCE GOVERNMENT OF	Staatsanleihen	1,87%	Frankreich
JAPAN GOVT (10 YEAR ISSUE)	Staatsanleihen	1,79%	Japan



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

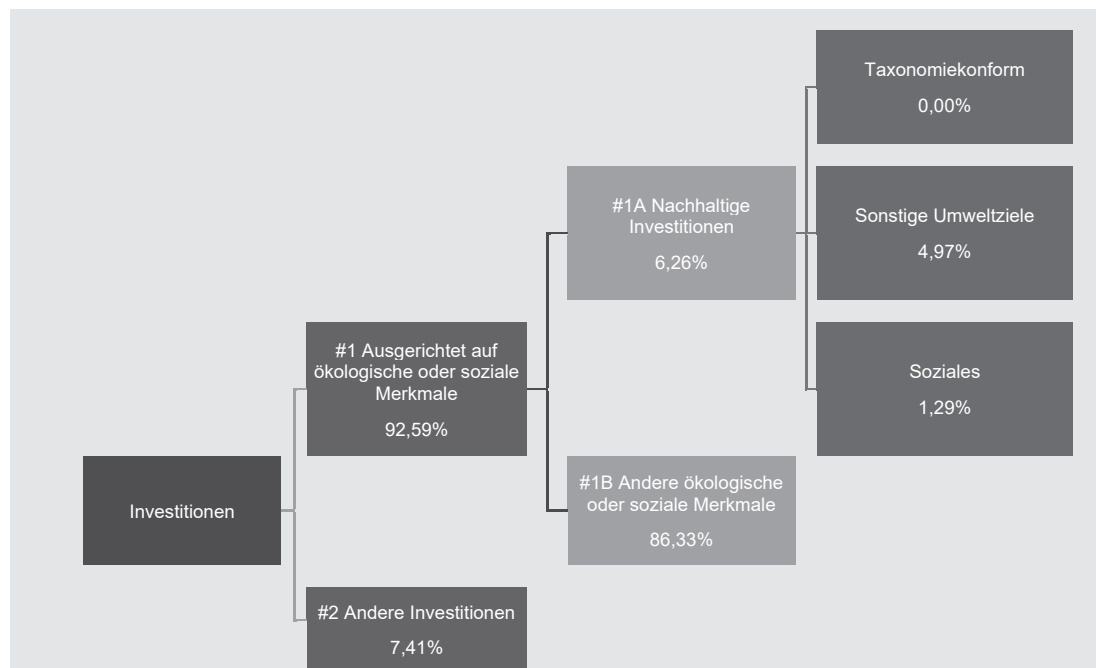
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 6,26 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

92,59 % des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (7,41 %) war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.

Von dem Fondssegment, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 6,26 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	92,59%	94,68%	100,00%	90,50%
#2 Andere Investitionen	7,41%	5,32%	K. A.	9,50%
#1A Nachhaltige Investitionen	6,26%	1,23%	3,71%	1,60%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	86,33%	93,45%	96,29%	88,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	4,97%	1,23%	3,71%	1,60%
Soziales	1,29%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	50,47%
Finanzsektor	29,77%
Kommunikationsdienste	4,25%
Gesundheitssektor	1,93%
Immobilien	1,33%
Energie	1,31%
Versorgungsunternehmen	1,03%
Zyklische Konsumgüter	0,92%
Basiskonsumgüter	0,70%
Industrie	0,42%
Grundstoffe	0,30%
Informationstechnologie	0,16%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	50,47%
Finanzdienstleistungen	17,72%
Banken	8,60%
Kapitalmärkte	2,09%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	1,31%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	1,19%
Medien	1,16%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	1,15%
Stromversorger	0,97%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	0,96%
Versicherungen	0,74%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	0,72%
Mortgage Real Estate Investment Trusts (REITs)	0,62%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	0,60%
Unterhaltung	0,58%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

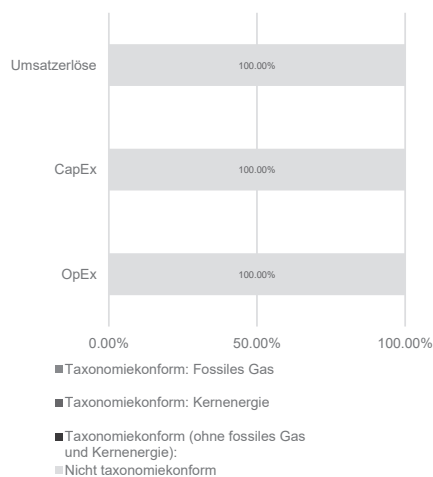
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

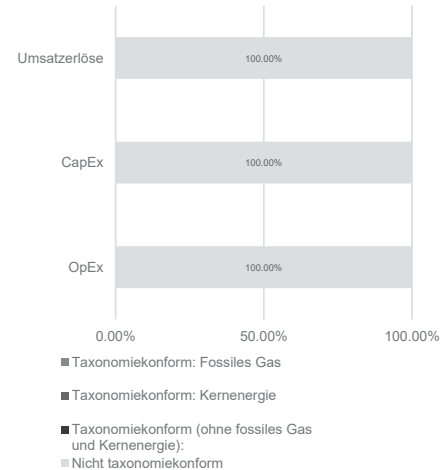
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Im Einklang mit seiner Anlagestrategie, nämlich der Verpflichtung des Fonds zur Aufrechterhaltung eines bestimmten Minimums an „nachhaltigen Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung gemäß Art. 2 Abs. 17, die laut der Taxonomie-Verordnung der EU nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können, enthielt der Fonds 4,97 % „nachhaltige Anlagen“ mit einer ökologischen Zielsetzung, die laut der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig eingestuft werden können.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 7,41 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz oder Emittenten, für die kein ESG-Rating verfügbar war.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Western Asset ist der Meinung, dass ESG-Faktoren, die in finanzieller Hinsicht von wesentlicher Bedeutung sind, die Kreditwürdigkeit von Emittenten festverzinslicher Wertpapiere beeinflussen und daher Auswirkungen auf die Wertentwicklung von Portfolios mit festverzinslichen Wertpapieranlagen haben können. Diese Faktoren stimmen vollkommen mit der langfristigen, fundamental wertorientierten Anlagephilosophie der Firma überein. Die Research-Analysten von Western Asset waren für die Bereitstellung von Fundamentaldatenanalysen auf Branchen- und Emittentenebene sowie für Meinungsäußerungen zu Risiko/Ertragsmerkmalen der Branchen und Emittenten durch die Einbeziehung wichtiger ESG-Überlegungen verantwortlich. Mithilfe dieses breiteren Ansatzes war der Fonds bestrebt, seine ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen, indem er in Emittenten investiert, so dass das Gesamtportfolio bestimmte minimale ESG-Ratings erfüllt. Dabei sollten seine Ausrichtung auf Dekarbonisierung und SDG erreicht sowie Emittenten vermieden werden, die, anhand von SRI-Ausschlüssen ermittelt, bestimmten Sektoren zugeordnet wurden, und in die im Rahmen von bestimmten Anlagezielen investiert wurde.

Um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erreichen, galt für den Fonds Folgendes:

- A. Der Fonds war bestrebt, ein durchschnittliches MSCI ESG-Rating von mindestens BBB zu erreichen.
- B. Der Fonds strebte insgesamt eine gewichtete durchschnittliche Kohlenstoffintensität („WACI“) mindestens 20 % unterhalb der Benchmark an. Damit sollte der Fonds auf die PAI-Indikatoren Nr. 3 und Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) ausgerichtet werden.
- C. Der Fonds war bestrebt, mindestens 20 % seines NIW in Wertpapiere von Emittenten zu investieren, deren Aktivitäten zum Erreichen von mindestens einem von acht ausgewählten SDG beitragen.
- D. Der Fonds schließt Emittenten aus, die gegen eine Reihe von SRI-Zielen verstoßen, wie unten ausgeführt:
 - a. Emittenten, die mehr als 5 % ihres Umsatzes aus der Tabakproduktion und/oder dem Vertrieb und der Herstellung von Atomwaffen erzielen.
 - b. Emittenten, die mehr als 10 % ihrer Einnahmen aus zivilen Schusswaffen (Herstellung oder Lieferung), konventionellen Waffen oder dem Abbau von Kraftwerkskohle (Produktion und Vertrieb) erzielen.
 - c. Emittenten, die umstrittene Waffen herstellen (Antipersonenminen, biochemische Waffen, blendende Laserwaffen, abgereichertes Uran, Brandwaffen und nicht aufspürbare Splitter), Eigentümer eines Unternehmens für umstrittene Waffen sind oder sich im Besitz eines Unternehmens für umstrittene Waffen befinden, entsprechend PAI-Indikator Nr. 14 (Umstrittene Waffen).
 - d. Emittenten, die laut internem Research, das Lücken in der Zielerreichung der Emittenten feststellen soll, gegen den UNGC und die OECD-Prinzipien verstoßen, entsprechend PAI-Indikator Nr. 10 (Soziales und Beschäftigung).

Als Teil des Minimums von 1 % an Investitionen in nachhaltige Anlagen (definiert als grüne, soziale, nachhaltige und nachhaltigkeitsgebundene Anleihen) hatte der Fonds zum 28. Februar 2026 gemessen am prozentualen Marktwert 5,96 % investiert.

Der Fonds erfüllte seine ökologischen und/oder nachhaltigen Merkmale, wie unten hervorgehoben:

- A. Der Fonds hatte laut MSCI ESG ein Rating von BBB.
- B. Die WACI des Fonds lag insgesamt bei 77,6 % der Benchmark.
- C. Die Allokation des Fonds in Emittenten und Emissionen, die mit den SDGs in Einklang stehen, lag bei 25,2 %.
- 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.

FTGF Brandywine Global Fixed Income Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300TFZOEP7EEQG432



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☐ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte ökologische und soziale Merkmale und wendete dabei mehrere Ansätze an, die miteinander verknüpft sind. Jedes Land wurde unter Verwendung der ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung bewertet, bei der über 60 Eingabekriterien berücksichtigt werden („60+ Input ESG-Bewertungsmethode“). Dabei wurden die Merkmale in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung untersucht. Zu diesen Merkmalen zählten unter anderem die Bewertung der klimabedingten physischen und Übergangsrisiken, der Umweltschutzmaßnahmen und der Abfallwirtschaft, der Arbeitnehmerrechte, der Aus- und Weiterbildung, der individuellen und institutionellen Freiheit, der Frauen- und Kinderrechte und deren Schutzes, der Kriminalität und der Korruption. Möglicherweise wurden mitunter noch weitere Merkmale untersucht, die die uneingeschränkte Strategie des Fonds widerspiegeln. Mit der „60+ Input ESG-Bewertungsmethode“ der Anlageverwaltung wurden Scores und Rankings für Portfolios und investierbare Anlageuniversen erstellt, wobei Emittenten, die zu den schwächsten 10 % zählten, von der Betrachtung ausgeschlossen wurden. Diese Scores waren auch dafür ausschlaggebend, um wichtige Engagement-Themen mit den Emittenten im zweitniedrigsten Dezil (80. bis 90. Perzentil) anzugehen. Behandelt wurde unter anderem auch das Thema der Treibhausgasemissionen, ein verpflichtender staatlicher PAI-Indikator.

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: Nicht zutreffend.

B. Nachverfolgung der relevanten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), wie z. B. des PAI Nr. 15 (THG-Intensität).

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO ₂ e/Mio. USD Umsatz	212,63	95,40%	265,31	95,03%	386,70	83,31%	488,87	86,14%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	229,91	95,40%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

· Vorheriger Zeitraum: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

· Laufender Zeitraum: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

· Vorheriger Zeitraum: Mexiko

· Laufender Zeitraum: Nicht zutreffend.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Nicht zutreffend. Der Fonds verpflichtet sich nicht zu nachhaltigen Investitionen.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAIs für Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienten. Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen Schwellenwerte für das Prinzip „keine erheblichen Beeinträchtigungen“ auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Die zwei PAIs für Staaten (PAI 15 (THG-Emissionsintensität) und PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen) waren Bestandteil der eigenen ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
US TREASURY FLOATING RATE NOTE	Staatsanleihen	35,23%	USA
United States Treasury Note/Bond	Staatsanleihen	28,86%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

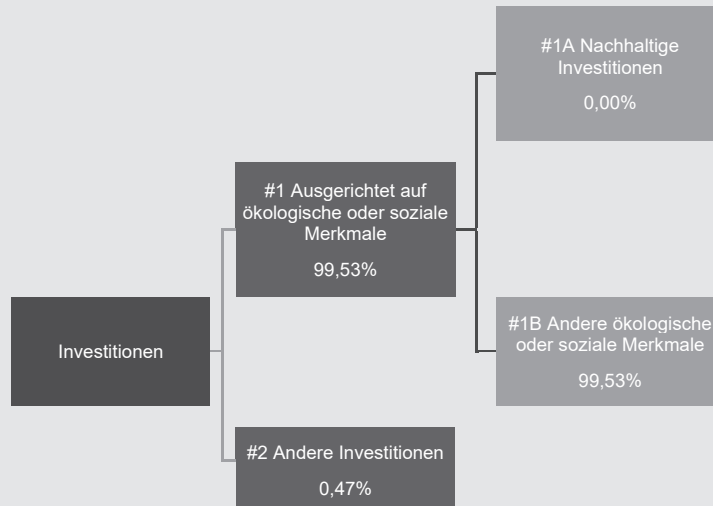
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0,00 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,53 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,47 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Der Fonds tätigte 0,00 % nachhaltige Investitionen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,53%	96,27%	97,46%	97,43%
#2 Andere Investitionen	0,47%	3,73%	2,54%	2,57%
#1A Nachhaltige Investitionen	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	99,53%	96,27%	97,46%	97,43%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	97,53%
Finanzsektor	2,00%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Staatsanleihen	97,53%
Finanzdienstleistungen	2,00%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

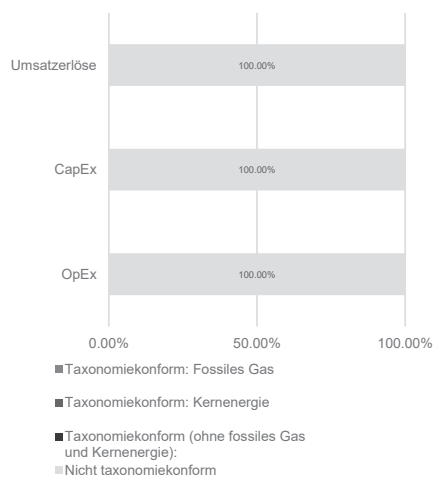
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

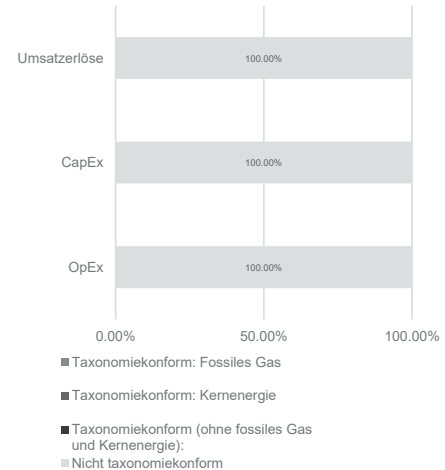
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

0,00 % der Fondsinvestitionen waren nicht mit der EU-Taxonomie konforme nachhaltige Investitionen mit einer ökologischen Zielsetzung.

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.

Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Fonds investierte 0,00 % in sozial nachhaltige Anlagen.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil von 0,47 % an Investitionen auf, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.
2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweithöchsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Nicht zutreffend.
3. Bis zu 90 % der Investitionen wurden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von den Umweltschutz und soziale Aspekte betreffenden Faktoren nachverfolgt und überwacht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF Brandywine Global Income Optimiser Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003731Z316KVU890



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 2,93% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte ökologische und soziale Merkmale und wendete dabei mehrere Ansätze an, die miteinander verknüpft sind. Jedes Land wurde unter Verwendung der ESG-Scoring-Methode der Anlageverwaltung bewertet, bei der über 60 Eingabekriterien berücksichtigt werden („60+ Input ESG-Bewertungsmethode“). Dabei wurden die Merkmale in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung untersucht. Zu diesen Merkmalen zählten unter anderem die Bewertung der klimabedingten physischen und Übergangsrisiken, der Umweltschutzmaßnahmen und der Abfallwirtschaft, der Arbeitnehmerrechte, der Aus- und Weiterbildung, der individuellen und institutionellen Freiheit, der Frauen- und Kinderrechte und deren Schutzes, der Kriminalität und der Korruption. Möglicherweise wurden mitunter noch weitere Merkmale untersucht, die die uneingeschränkte Strategie des Fonds widerspiegeln. Mit der „60+ Input ESG-Bewertungsmethode“ der Anlageverwaltung wurden Scores und Rankings für Portfolios und investierbare Anlageuniversen erstellt, wobei Emittenten, die zu den schwächsten 10 % zählten, von der Betrachtung ausgeschlossen wurden. Diese Scores waren auch dafür ausschlaggebend, um wichtige Engagement-Themen mit den Emittenten im zweitniedrigsten Dezil (80. bis 90. Perzentil) anzugehen. Behandelt wurde unter anderem auch das Thema der Treibhausgasemissionen, ein verpflichtender staatlicher PAI-Indikator.

Bei Unternehmensemittenten verwendete die Anlageverwaltung Daten von Dritten im Rahmen ihres proprietären ESG-Bewertungsprozesses, wobei die ESG-Säulen entsprechend dem GICS-Sektor des Emittenten gewichtet wurden. Diese Faktoren stützten sich auf Aspekte wie Emissionen, Abfälle, Erzeugung und Nutzung erneuerbarer Energie, Arbeitsrechte und Schutz der Arbeitnehmer, Inklusion und die allgemeine Wirksamkeit und Transparenz des oberen Managements im Berichtszeitraum.

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. Minerva Luxembourg SA, Mohegan Tribal Gaming, FTAI Aviation Investors LLC und Taseko Mines Ltd rutschten in das untere Dezil ab und wurden abgestoßen. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

1. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Regierung Ägyptens, Regierung Brasiliens, Ero Copper Corp, Cleveland-Cliffs Inc.

B. Nachverfolgung der relevanten Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI-Indikatoren), wie z. B. des PAI Nr. 15 (THG-Intensität).

C. Die Verwendung der Anleiheerträge durch die Emittenten, vor allem die Ertragsverwendung bei grünen, sozialen, nachhaltigen oder Übergangs-Anleihen, die die Vorgaben des Fonds für nachhaltige Investitionen in Prozent des Nettovermögens erfüllen. Der Fonds investierte 2.93 % seines Nettovermögens in grüne und/oder soziale Anleihen, die nachhaltige Geldanlagen sind.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (USD)	tCO2e/Mio. USD Umsatz	475,37	23,54%	444,89	18,71%	437,25	24,40%	481,49	10,54%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	514,02	23,54%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Deshalb wurden die folgenden Veräußerungen vorgenommen:

· Vorheriger Zeitraum: Es wurden keine Veräußerungen vorgenommen, da sich keine Positionen im schwächsten Dezil befanden. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

· Laufender Zeitraum: BEEFBZ 8 7/8 09/13/33 144A, MOHEGN 8 1/4 04/15/30 REGS, MOHEGN 11 7/8 04/15/31 REGS, FTAI 5 1/2 05/01/28 144A, TKOCN 8 1/4 05/01/30 144A. Das schwächste Dezil blieb weiterhin ausgeschlossen.

Der Fonds behandelt Emittenten im zweitniedrigsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen:

· Vorheriger Zeitraum: Allegiant Travel Co, Arab Republic of Egypt, Civitas Resources Inc, Codelco Inc, Ero Copper Corp, Minerva Luxembourg SA, Mohegan Tribal Gaming AU, Nota do Tesouro Nacional, RenaissanceRe Holdings Ltd

· Laufender Zeitraum: Republik Südafrika

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 2.93 % seines Nettovermögens in grüne und/oder soziale Anleihen, die nachhaltige Geldanlagen sind. Der Fonds investierte nur in Anleihen, bei denen der Emittent angab, wofür die Erträge verwendet werden (und bei denen diese Angaben durch eine Drittpartei oder die Anlageverwaltung überprüft werden), und die zugrundeliegenden ökologischen oder sozialen Projekten zugutekamen, wie zum Beispiel:

- Saubere und erschwingliche Energie (Solarenergie und Biokraftstoffe)
- Saubere Mobilität
- Menschenwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum
- Umweltverträgliches Bauen
- Nachhaltige Städte und Gemeinschaften

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Bei der Bewertung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH-Grundsatz“) stützte sich die Anlageverwaltung auf internes Fundamentaldaten-Research, verkaufsseitiges Research, Angaben zu wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) und ESG-Daten von externen Anbietern.

Die Anlageverwaltung prüfte sämtliche bei Screening-Prüfungen von einem Drittanbieter angezeigten öffentlichen Sanktionen im Zusammenhang mit der Nichteinhaltung des UN Global Compact (UNGC) sowie Messdaten und KPIs im Zusammenhang mit den obligatorischen PAI-Prüfungen für Unternehmen und staatliche Emittenten. Für nachhaltige Geldanlagen in von staatlichen Stellen oder supranationalen Organisationen emittierte Wertpapiere prüfte die Anlageverwaltung den DNSH-Grundsatz auf Ebene der Ertragsverwendung (außer bei supranationalen Organisationen, deren spezifisches Leitbild vorsieht, dass alle finanzierten Aktivitäten/Projekte nachhaltig sein müssen).

Der Fonds überwachte die obligatorischen PAI-Werte, um Anlagen mit nachteiligen Auswirkungen zu ermitteln.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen DNSH-Schwellenwerte auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios. Dabei setzt die Anlageverwaltung zunächst auf aktive Zusammenarbeit mit den Emittenten und zieht sich erst als letzte Maßnahme aus einer Anlage zurück. Wurde ein wesentliches kurzfristiges Risiko entdeckt, veräußerte die Anlageverwaltung eine Anlage sofort.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung verfolgte Verstöße gegen OECD/UNGC-Grundsätze (die ab Januar 2022 automatisch von Dritten eingeholt werden) und Versäumnisse; Unternehmen, die sich nicht daran hielten, werden vom Portfolio/Anlageuniversum ausgeschlossen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Obligatorische PAI-Faktoren für Unternehmen und Staaten wurden nachverfolgt, gemessen und gemeldet. Die Anlageverwaltung nutzte zur Beurteilung von Verbesserungen und Verbesserungschancen auch Veränderungen in PAIs und damit zusammenhängenden KPIs, die daher als Informationsgrundlage für Anlagen und Positionsgrößen dienen.

Die Anlageverwaltung beurteilte bei Anlageentscheidungen Schwellenwerte für das Prinzip „keine erheblichen Beeinträchtigungen“ auf Ebene der Fundamentaldaten, Wirtschaftszweige/Branchen, Länder und Portfolios.

Nicht alle obligatorischen PAIs waren inhärente Bestandteile der eigenen ESG-Bewertung für diesen Fonds. Die Anlageverwaltung verfolgte dennoch die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) nach und beobachtete diese.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Western Asset US Dollar Liquidity Fund OEMF USD 1	Finanzsektor	5,52%	Irland
Mexican Bonos 8% 07/31/2053	Staatsanleihen	3,22%	Mexiko
Brazil Notas Do Tesouro Nacional Serie F 10% 01/01/2033	Staatsanleihen	3,04%	Brasilien
United Kingdom Gilt 3.75% 10/22/2053 REG S	Staatsanleihen	2,51%	Vereinigtes Königreich
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA5 FRN 06/25/2042 144A 2022-DNA5 M2	Finanzsektor	2,06%	USA
Echostar Corp 3.875% PIK TO 5/27 THEN 3.875% CASH 11/30/2030 CNV	Kommunikationsdienste	1,92%	USA
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA4 FRN 05/25/2042 144A 2022-DNA4 M2	Finanzsektor	1,86%	USA
Mexican Bonos 7.5% 05/26/2033	Staatsanleihen	1,81%	Mexiko
Freddie Mac STACR Trust 2018-HQA2 FRN 10/25/2048 144A 2018-HQA2 M2B	Finanzsektor	1,74%	USA
Connecticut Avenue Securities Trust 2020-SBT1 FRN 02/25/2040 144A 2020-SBT1 1M2	Finanzsektor	1,61%	USA
Freddie Mac STACR REMIC Trust 2022-DNA6 FRN 09/25/2042 144A 2022-DNA6 M2	Finanzsektor	1,48%	USA
Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/2027 STATED RATE 10%	Staatsanleihen	1,47%	Brasilien
United Wholesale Mortgage LLC 5.75% 06/15/2027 144A	Finanzsektor	1,26%	USA
Mineral Resources Ltd 9.25% 10/01/2028 144A	Grundstoffe	1,24%	Australien
Cleveland-Cliffs Inc 7% 03/15/2032 144A	Grundstoffe	1,16%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

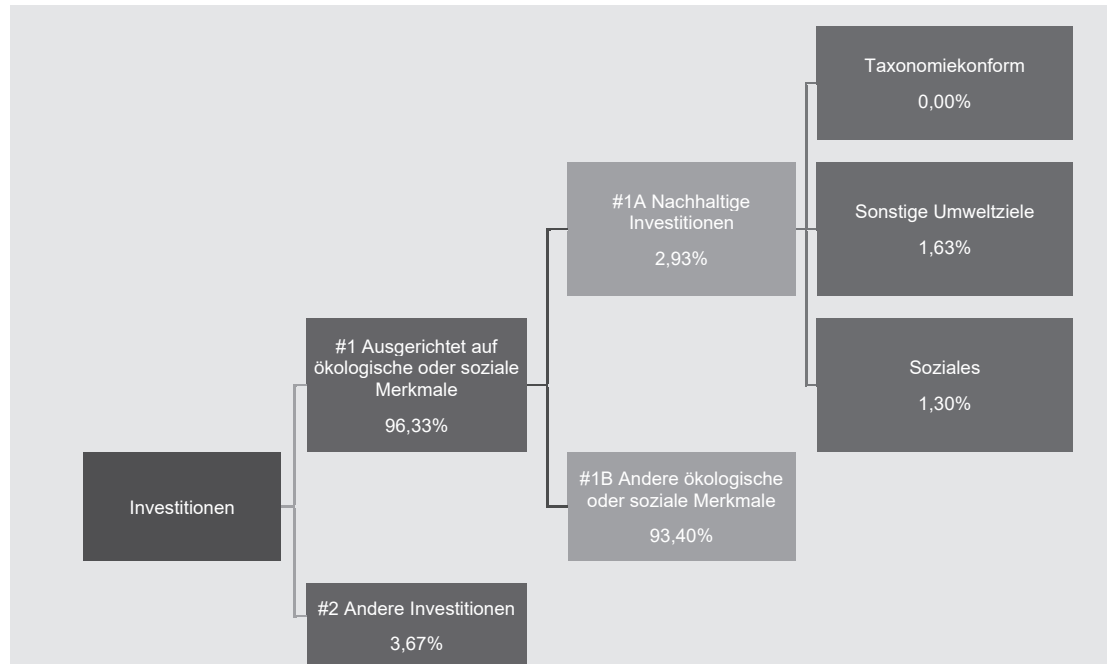
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 2,93 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,33 % des Portfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,67 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand vorwiegend aus liquiden Mitteln.

Für das Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 2,93 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,33%	95,19%	96,07%	93,75%
#2 Andere Investitionen	3,67%	4,81%	3,93%	6,25%
#1A Nachhaltige Investitionen	2,93%	4,78%	5,52%	1,18%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	93,40%	90,41%	90,55%	92,57%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	1,63%	4,78%	5,52%	1,18%
Soziales	1,30%	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	38,68%
Staatsanleihen	20,04%
Energie	11,29%
Industrie	7,19%
Grundstoffe	6,94%
Kommunikationsdienste	3,75%
Zyklische Konsumgüter	2,44%
Informationstechnologie	1,98%
Gesundheitssektor	1,81%
Versorgungsunternehmen	1,15%
Immobilien	0,97%
Basiskonsumgüter	0,10%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Finanzdienstleistungen	30,18%
Staatsanleihen	20,04%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	10,19%
Metalle u. Bergbau	5,36%
Verbraucherkreditgeschäft	3,53%
Banken	3,23%
Medien	2,63%
Passagierfluggesellschaften	2,25%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,03%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	1,92%
Kapitalmärkte	1,73%
Kommunikationsausrüstung	1,10%
Seetransport	1,10%
Energieanlagen und -dienstleistungen	1,10%
Pharmaindustrie	0,92%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

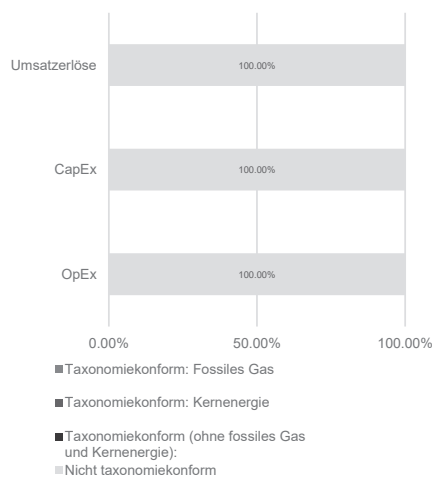
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

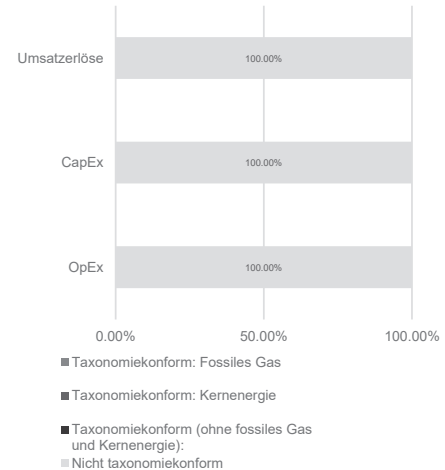
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

An nicht mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen mit einem Umweltziel wies das Finanzprodukt einen Anteil von 1,63 % auf.

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.

Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen.**



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil an Investitionen mit einem sozialen Ziel von 1,30 % auf.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Das Finanzprodukt wies einen Anteil von 3,67 % an Investitionen auf, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Der Fonds setzt sich zum Ziel, Emittenten im schwächsten Dezil des Anlageuniversums auszuschließen. Der Fonds schloss Anlagewerte, die sich im schwächsten Dezil befanden, aus. Im Berichtszeitraum gab es keine Emittenten im schwächsten Dezil.

2. Der Fonds behandelt Emittenten im zweitschwächsten Dezil als Kandidaten für ein Engagement. Daher wurden die folgenden Engagements vorgenommen: Ägypten, Ero Copper Corp, Celveland-Cliffs Inc, Brasilien

3. Bis zu 90 % der Investitionen wurden in Hinblick auf die Verschlechterung oder Verbesserung von den Umweltschutz und/oder soziale Aspekte betreffenden Faktoren nachverfolgt und überwacht.

4. Der Fonds investierte mindestens 1 % seines Nettovermögens in nachhaltige Anlagen mit ökologischen/sozialen Zielen, siehe oben.

5. Im Hinblick auf die folgenden Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Kraftwerkskohle
- Umstrittene Waffen, einschließlich Kernwaffen
- Erwachsenenunterhaltung

Der Fonds investierte nicht in Emittenten, die gemäß dem Global Compact der Vereinten Nationen als „durchgefallen“ bewertet wurden, und auch nicht in staatliche Emittenten, die als Rechtsgebiete mit hohem Risiko gelten oder von den United Nations Security Council Sanctions betroffen sind.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge US Value Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300OZGGIQZ97B7W66



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 34,61% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale umfassten:

- Investitionen in Unternehmen mit Zielen zur Verringerung der Treibhausgasintensität und der Treibhausgasemissionen,
- Dialog mit Unternehmen, um sie zu motivieren, ihre Geschäftsmodelle anzupassen, Emissionsreduktionsziele festzulegen und ihre Strategien zum Klimawandel offenzulegen, und
- die wichtigsten Umwelt-, Sozial- und Governance-Merkmale (ESG), die für das jeweilige Unternehmen und die Branche, in der das Unternehmen tätig ist, als wesentlich erachtet werden, darunter unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt und Klimarisiken.

Im Hinblick auf seine Investments hielt der Fonds seine Verpflichtung ein, mindestens 10 % 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:

- 34,6 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

- Alle Indikatoren für nachteilige Auswirkungen (PAI), die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung sind, insbesondere PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen). Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- Abstimmung über 914 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden,

- Der Prozentsatz des Portfolios mit einem B-Rating laut unternehmenseigenem ESG-Ratingsystem der Anlageverwaltung lag bei 0,0 %.

- Unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich				
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	37,39%	33,32%	34,79%	20,65%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	0,00%	3,31%	10,25%	16,06%

PAI im historischen Vergleich									
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	369.163,90	99,02%	900.668,41	96,81%	827.154,39	96,33%	747.211,99	96,45%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	503,89	99,02%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	1.639,35	99,02%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,48%	0,00%	97,68%	0,00%	96,75%	0,00%	98,96%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgrremiums	32,93%	98,48%	34,93%	96,57%	36,65%	92,03%	34,34%	94,40%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,48%	0,00%	96,57%	0,00%	92,03%	0,00%	94,40%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Bereiche leisteten:

- durch ihre Produkte und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Ziele der Ziele für nachhaltige Entwicklung der UN (SDGs) und den ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren, wobei ihr Beitrag durch die Bewertung des Anlageverwalters ermittelt wird,

- Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder die Klimaschutzlösungen anbieten. Die Emittenten wurden 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 wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die Umsätze generieren aus (a) ausgeschlossenen Waffen gemäß (i) dem Übereinkommen über das Verbot des Einsatzes, der Lagerung, der Herstellung und der Weitergabe von Antipersonenminen und über deren Vernichtung und (ii) dem Übereinkommen über das Verbot von Streumunition und (b) Waffen, die als B- oder C-Waffen gemäß dem Biowaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen bzw. dem Chemiewaffen-Übereinkommen der Vereinten Nationen eingestuft sind.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
BANK OF AMERICA CORP	Finanzsektor	3,52%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,94%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	2,59%	USA
EQT CORP	Energie	2,31%	USA
Walt Disney Co/The	Kommunikationsdienste	2,31%	USA
MICRON TECHNOLOGY INC	Informationstechnologie	2,09%	USA
Corebridge Financial Inc	Finanzsektor	2,06%	USA
CVS HEALTH CORP	Gesundheitssektor	2,06%	USA
GILEAD SCIENCES INC	Gesundheitssektor	1,88%	USA
CHEVRON CORP	Energie	1,88%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	1,88%	USA
SIEMENS AG	Industrie	1,83%	Deutschland
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	1,82%	USA
CHARLES SCHWAB CORP	Finanzsektor	1,81%	USA
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	Industrie	1,80%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

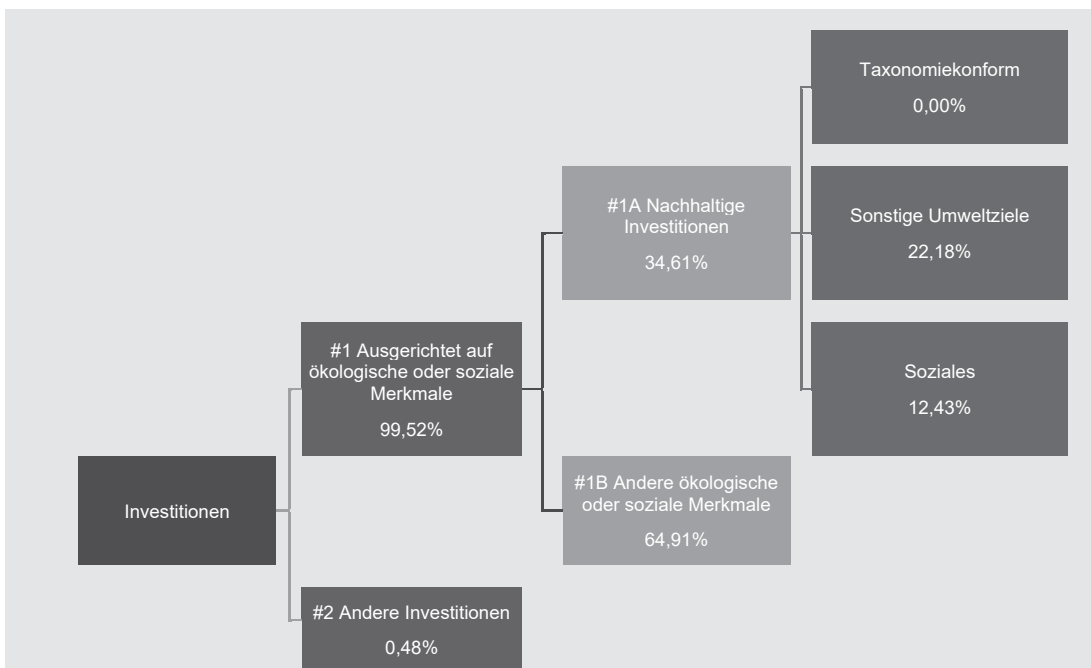
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 34,61 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,52 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,48 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 34,61 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,52%	97,92%	98,10%	98,96%
#2 Andere Investitionen	0,48%	2,08%	1,90%	1,04%
#1A Nachhaltige Investitionen	34,61%	31,88%	30,40%	29,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	64,91%	66,04%	67,70%	69,96%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	22,18%	20,89%	24,70%	16,00%
Soziales	12,43%	10,99%	5,70%	13,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	21,59%
Gesundheitssektor	17,97%
Industrie	11,49%
Energie	10,29%
Grundstoffe	8,07%
Kommunikationsdienste	6,47%
Informationstechnologie	5,89%
Versorgungsunternehmen	5,72%
Zyklische Konsumgüter	5,17%
Basiskonsumgüter	4,56%
Immobilien	2,29%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	8,68%
Pharmaindustrie	6,98%
Finanzdienstleistungen	6,86%
Banken	6,64%
Metalle u. Bergbau	4,47%
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	4,37%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,88%
Biotechnologie	3,81%
Versicherungen	3,67%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,58%
Chemische Erzeugnisse	3,31%
Stromversorger	3,14%
Kapitalmärkte	2,61%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	2,59%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,37%

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 Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

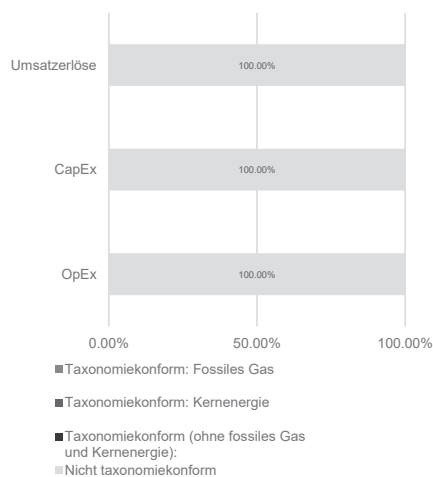
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

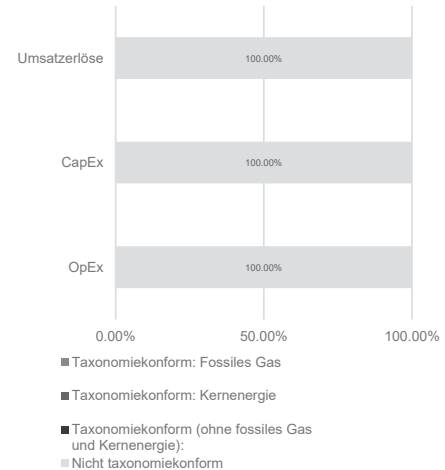
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio mit Stand vom 28.02.2026 zu 22,18 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 12,43 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,48 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 11 %

AA: 69 %

A: 20 %

B: 0 %

1. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Darüber hinaus tauschte sich die Anlageverwaltung regelmäßig direkt mit den Unternehmen mit einem B-Rating, in die der Fonds investiert, aus, um die wesentlichen ökologischen und/oder sozialen Merkmale dieser Unternehmen zu verbessern.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

2. Im Hinblick auf die folgenden Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes direkt aus konventionellen Waffen generieren,
- Umstrittene Waffen
- Tabak
- Unternehmen, die mehr als 30 % ihrer Umsatzerlöse aus der Kohleverstromung erzielen, oder
- Abbau oder Vertrieb von Kraftwerkskohle oder Kokskohle.

3. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF Putnam US Research Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300SQ18HYQNNQ20536



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☐ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog mit dem oberen Management und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu erörtern und anzugehen, die wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale sind 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 gehören unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Derivate wurden zur Erreichung der und/oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt. Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die CO₂-Intensität des Fonds war im Berichtszeitraum niedriger als die der Benchmark. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Intensität des Fonds (einschließlich Scope 1 und 2) betrug 81,1 (tCO₂e/Mio. \$ Umsatz) und lag 14 % unter der der Benchmark (Scope 1 und 2), die 94,30 (tCO₂e/Mio. \$ Umsatz) betrug.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Das Engagement des Fonds in Emittenten mit dem ESG-Risiko-Rating „Vernachlässigbar“, „Niedrig“ oder „Mittel“ von Sustainalytics betrug im Berichtszeitraum 89,83 % und lag damit über dem Mindestziel des Fonds von 60 %.
- 100 % der Investitionen hielten die zehn Grundsätze des UN Global Compact ein.
- 100 % der Investitionen entsprachen den Ausschlussfiltern für die Geschäftstätigkeit in Bezug auf umstrittene Waffen, konventionelle Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Tabak und ähnliche Erzeugnisse und Kraftwerkskohle.
- Spezifische PAI-Indikatoren, nämlich: PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen), die berechnet wurden. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.
- Im Berichtszeitraum fand ein regelmäßiger Austausch über ESG-Themen statt, um die Pläne der Emittenten zur Steuerung wesentlicher ESG-Risiken und die Fortschritte gemessen an diesen Plänen zu bewerten. Die Ansichten des Investment-Teams zum ESG-Risikomanagement der Emittenten, wie bei diesen Besprechungen erörtert, spiegeln sich in der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider. Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu unternehmerischer Verantwortung: <https://www.franklintempleton.com/forms-literature/download/ESPOL-B>.
- Die Anlageverwaltung nahm an 51 Abstimmungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung zur Förderung einer guten Unternehmensführung und zur Verbesserung der Nachhaltigkeitspraktiken teil.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2026	
	Wert	
Prozentuale Differenz zwischen der CO2-Intensität des Portfolios und der Benchmark, einschließlich Scope 1 und Scope 2 (tCO2e/Mio. \$ Umsatz)	-14,00%	
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die im Hinblick auf das ESG-Risiko mit „Mittel“ oder „Vernachlässigbar“/„Niedrig“ bewertet sind	89,83%	
Prozentualer Anteil der Investitionen, die mit dem UN Global Compact konform sind	100,00%	
Prozentualer Anteil der Investitionen, die den Ausschlussfiltern des Fonds in Bezug auf Geschäftstätigkeiten entsprechen	100,00%	

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)	tCO2e/Mio. € Umsatz	84,28	96,66%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	97,08%	0,00%	98,66%	0,16%	98,83%	0,00%	95,72%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,99%	0,00%	98,66%	0,00%	98,83%	0,00%	95,72%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Mit Wirkung vom 28. April 2025 wurde The Putnam Advisory Company, LLC, zum Anlageverwalter des Fonds bestellt und der Fonds wurde in FTGF Putnam US Research Fund umbenannt (vormals FTGF ClearBridge US Appreciation Fund). In diesen Änderungen spiegelt sich die neue Ausrichtung der Anlagestrategie wider. Dementsprechend sind Vergleiche mit Vorjahren unter Umständen nicht aussagekräftig oder überhaupt nicht möglich.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen, als der Fonds von ClearBridge verwaltet wurde, war der PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität) mit USD als Einheit angegeben. Seit den Änderungen in Bezug auf den Fonds wird dieser Wert in Euro angegeben. Die früher in USD ausgewiesenen Werte werden nicht angezeigt, da sie nicht vergleichbar sind.

Für den PAI Nr. 10 („Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen“) wurde für 2024 ein Wert von 0,16 % auf der Grundlage der von MSCI bereitgestellten Daten ausgewiesen. In dem ausgewiesenen Engagement spiegeln sich Dateneingaben von Dritten wider, die möglicherweise zeitlichen Beschränkungen oder solchen im Zusammenhang mit der Datenverfügbarkeit unterliegen. Die Position wurde für eine begrenzte Zeit während des Berichtsjahres gehalten und dann abgestoßen. Für solche Fälle wurde eine Compliance-Überwachung eingerichtet.

● 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.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.

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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

· PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität) – Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen ihres Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Die CO₂-Intensität (einschließlich Scope 1- und Scope 2-Emissionen) des Portfolios des Fonds war im Vergleich zu seiner Benchmark niedriger. Die CO₂-Intensität ist die Menge (in Tonnen) der Gesamtemissionen, die einem Portfolio zuzurechnen sind, pro investierter Million Dollar (USD). Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus eigenen Geschäftsbetrieb eines Emittenten, während Scope-2-Emissionen indirekte Emissionen aus dem vom Emittenten bezogenen und verbrauchten Strom sind. Die CO₂-Intensität des Gesamtportfolios des Fonds wird durch den Anteil des Fonds an den Emittenten des Portfolios aufgeteilt, d. h. eigene Emissionen geteilt durch eigene Umsätze. Die Benchmark wurde nicht für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt. Zur Überwachung der CO₂-Intensität des Fonds im Vergleich zur Benchmark zog die Anlageverwaltung einen Drittanbieter heran.

· PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien) – Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die der Bewertung zufolge den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien nicht beachten.

· PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretrminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	6,74%	USA
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	6,64%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	4,83%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	4,54%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	4,35%	USA
Broadcom Inc	Informationstechnologie	3,24%	USA
Meta Platforms Inc	Kommunikationsdienste	2,93%	USA
TESLA INC	Zyklische Konsumgüter	1,90%	USA
Cisco Systems Inc	Informationstechnologie	1,88%	USA
MASTERCARD INC	Finanzsektor	1,70%	USA
Eli Lilly & Co	Gesundheitssektor	1,63%	USA
EXXON MOBIL CORP	Energie	1,62%	USA
ANALOG DEVICES INC	Informationstechnologie	1,53%	USA
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	Industrie	1,45%	USA
COCA-COLA CO	Basiskonsumgüter	1,42%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0,00 %.

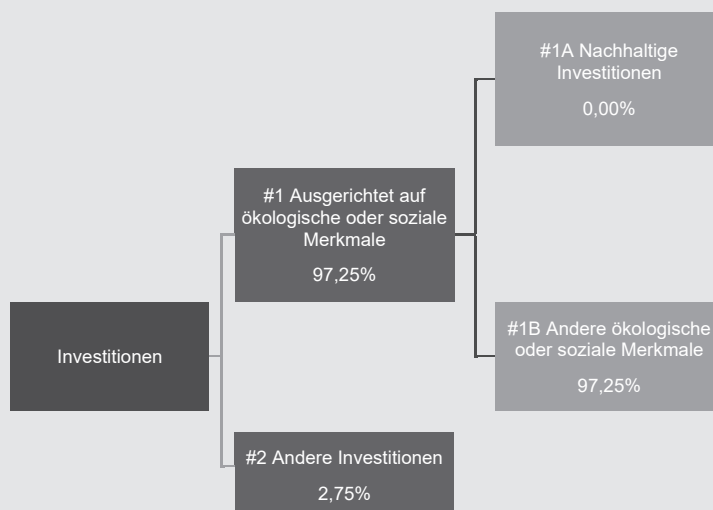
Die **Vermögensallokation** gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,25 % des Portfolios des Fonds waren auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,75 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 0,00 % in nachhaltige Anlagen.

Wir weisen darauf hin, dass sich die Vermögensallokation in Vorjahren auf die frühere Anlagestrategie bezog, die Mindestanforderungen für die sozialen und ökologischen nachhaltigen Investitionen des Fonds vorsah.



#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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	97,25%	98,66%	98,65%	95,72%
#2 Andere Investitionen	2,75%	1,34%	1,35%	4,28%
#1A Nachhaltige Investitionen	K. A.	58,49%	65,31%	59,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	97,25%	40,17%	33,34%	36,72%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	K. A.	49,36%	47,90%	40,00%
Soziales	K. A.	9,13%	17,41%	19,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	31,78%
Finanzsektor	13,00%
Kommunikationsdienste	10,49%
Gesundheitssektor	10,48%
Zyklische Konsumgüter	9,15%
Industrie	7,04%
Basiskonsumgüter	5,25%
Energie	3,49%
Grundstoffe	2,36%
Versorgungsunternehmen	2,11%
Immobilien	2,10%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	14,94%
Software	8,90%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,28%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	5,98%
Allgemeiner Einzelhandel	4,54%
Finanzdienstleistungen	4,39%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	3,47%
Versicherungen	3,02%
Pharmaindustrie	2,90%
Unterhaltung	2,73%
Banken	2,38%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,18%
Kapitalmärkte	2,16%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,16%
Automobilindustrie	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 Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

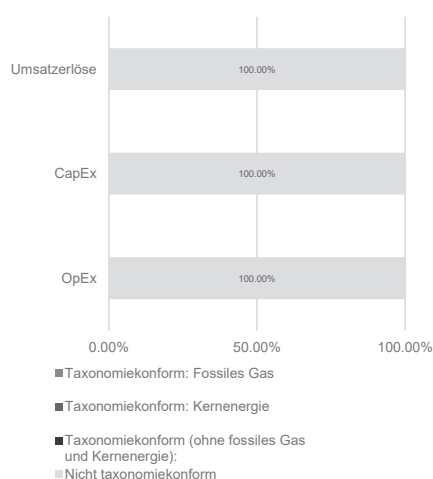
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

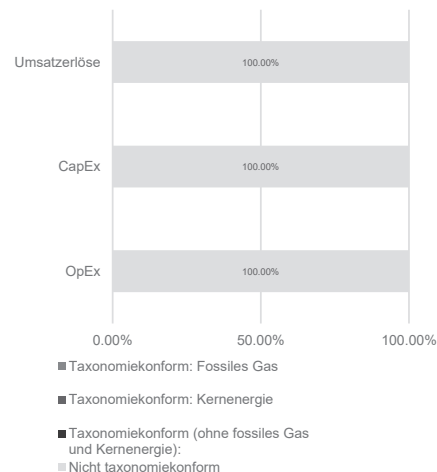
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.



sind nachhaltige Investitionen mit einem



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Nicht zutreffend.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 2,75 % und umfasste Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente und Derivate.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog mit dem oberen Management und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu erörtern und anzugehen, die wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Die folgenden Maßnahmen wurden ergriffen:

- Förderung eines wirksamen Managements des Klimarisikos und der Energieeffizienz durch Investitionen in Emittenten mit geringerer CO2-Intensität,
- Förderung eines besseren oder verbesserten Unternehmensverhaltens, einschließlich positiver Arbeitsbeziehungen und/oder einer langfristigen Geschäftsstrategie, indem mindestens 60 % des Portfolios in Emittenten mit einem ESG-Rating von „Mittel“, „Niedrig“ oder „Vernachlässigbar“ investiert werden,
- Förderung der Einhaltung der internationalen Normen durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen,
- Förderung des sozialen Wohlergehens durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die an der Herstellung und/oder am Vertrieb konventioneller Waffen, an der Herstellung und/oder am Vertrieb umstrittener Waffen, wie in der Franklin Templeton EU Funds Policy beschrieben, und an der Herstellung und/oder am Vertrieb von Erwachsenenunterhaltung beteiligt sind,
- Förderung der öffentlichen Gesundheit durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die im Tabakgeschäft tätig sind,
- Förderung umweltfreundlicher Unternehmenspraktiken durch Beschränkung der Investitionen in Emittenten, die im Kraftwerkskohlegeschäft tätig sind.

Im Berichtszeitraum fand ein regelmäßiger Austausch mit den Portfoliounternehmen über ESG-Themen statt, um die Pläne der Emittenten zur Steuerung wesentlicher ESG-Risiken und die Fortschritte gemessen an diesen Plänen zu bewerten. Die Ansichten des Investment-Teams zum ESG-Risikomanagement der Emittenten, wie bei diesen Besprechungen erörtert, spiegeln sich in der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider. Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu unternehmerischer Verantwortung: <https://www.franklintempleton.com/forms-literature/download/ESPOL-B> Im Berichtszeitraum nahm der Fonds an 304 Abstimmungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung zur Förderung einer guten Unternehmensführung und zur Verbesserung der Nachhaltigkeitspraktiken teil.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge US Large Cap Growth Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
5493003YRBLHS9UVBW79



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 51,93% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

· 51,9 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

· Spezifische PAI-Indikatoren, nämlich PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen). Siehe die

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

· Unternehmenseigene Methoden, um den Fortschritt der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt regelmäßige ESG-Engagement-Meetings mit seinen Portfoliounternehmen ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegelten sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

· Abstimmung über 588 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden.

· Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 42 %
- AA: 41 %
- A: 17 %
- B: 0 %

Der Fonds misst 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; 76 %

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	69,97%	62,15%	59,73%	44,24%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	6,02%	5,07%	16,36%	23,62%

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	79.415,32	98,72%	122.842,96	97,44%	151.371,76	97,27%	106.503,87	95,26%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	50,62	98,72%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	295,62	98,72%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,72%	0,00%	97,44%	0,00%	97,27%	0,00%	95,26%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsrats	34,76%	98,72%	35,24%	97,44%	35,78%	96,64%	34,89%	95,26%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,72%	0,00%	97,44%	0,00%	96,64%	0,00%	95,26%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wurde;

- Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder die Klimaschutzlösungen anbieten. Die Emittenten wurden 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 wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	9,30%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	7,89%	USA
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	7,74%	USA
Meta Platforms Inc	Kommunikationsdienste	7,01%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	5,52%	USA
VISA INC	Finanzsektor	4,54%	USA
NETFLIX INC	Kommunikationsdienste	4,29%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	2,88%	USA
INTUITIVE SURGICAL INC	Gesundheitssektor	2,51%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

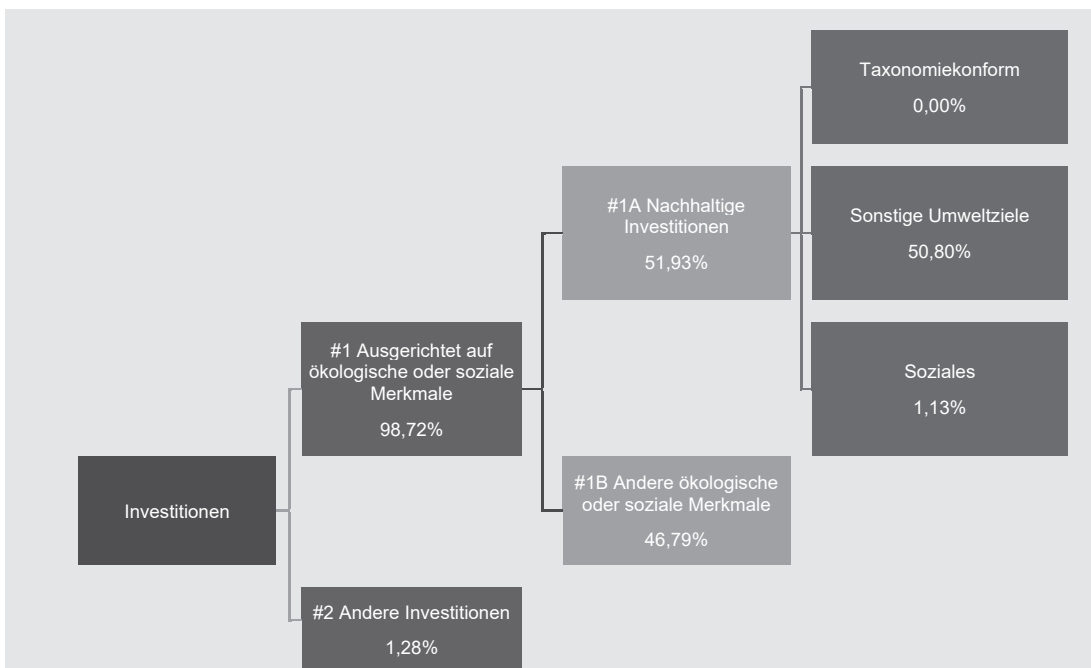
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 51,93 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

98,72 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (1,28 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 51,93 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,72%	97,44%	97,60%	96,29%
#2 Andere Investitionen	1,28%	2,56%	2,40%	3,71%
#1A Nachhaltige Investitionen	51,93%	70,82%	79,00%	65,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	46,79%	26,62%	18,60%	31,29%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	50,80%	70,82%	63,70%	49,00%
Soziales	1,13%	K. A.	15,30%	16,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	40,78%
Kommunikationsdienste	14,18%
Zyklische Konsumgüter	13,17%
Industrie	8,69%
Gesundheitssektor	8,45%
Finanzsektor	8,37%
Grundstoffe	2,73%
Basiskonsumgüter	1,34%
Immobilien	1,01%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Software	18,81%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	15,44%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	9,89%
Allgemeiner Einzelhandel	7,89%
Finanzdienstleistungen	5,60%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	5,52%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	4,31%
Unterhaltung	4,29%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,02%
Chemische Erzeugnisse	2,73%
Elektrogeräte	2,40%
Überlandtransport	2,27%
Automobilindustrie	2,26%
Handels- und Vertriebsgesellschaften	2,05%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	1,58%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

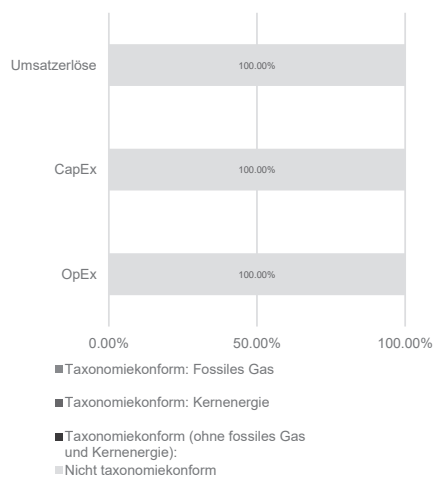
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

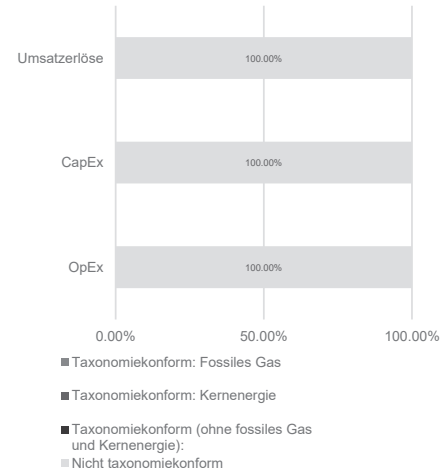
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio mit Stand vom 28.02.2026 zu 50,80 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1,13 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 1,28 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 42 %

AA: 41 %

A: 17 %

B: 0 %

1. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

2. Wie im Prospekt dargelegt, investierte der Fonds nicht in:

- Unternehmen, die 10 % oder mehr ihres Umsatzes direkt aus konventionellen Waffen generieren,
- Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen erzielen,
- Umstrittene Waffen
- Tabak
- Erwachsenenunterhaltung
- Unternehmen, die mehr als 30 % ihres Umsatzes aus der Kohleverstromung oder aus dem Abbau und dem Vertrieb von Kraftwerkskohle oder Kokssteinkohle erzielen.

3. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge US Equity Sustainability Leaders Fund (der „Fonds“)



FRANKLIN
TEMPLETON

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300RLIXEW79ZFOB12

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologischen nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: 0,00%
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 90,64% an nachhaltigen Investitionen
 - ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Während des Berichtszeitraums investierte die Anlageverwaltung als Teil ihrer Anlagepolitik in Unternehmen mit unterschiedlicher Marktkapitalisierung und unterstützte somit starke oder sich verbessernde ökologische, soziale und Governance- („ESG“) Merkmale. Der Fonds ermittelt anhand eines etablierten, eigenen Research- und Engagement-Prozesses, ob ein Unternehmen ein Sustainability Leader ist. Dieses unternehmenseigene Verfahren umfasst die Schaffung eines ESG-Ratingsystems, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifizierte, die für das Investment relevant waren. Diese Merkmale umfassten unter anderem:

- Energieeffizienz
- Sauberer Strom
- Technologien zur Senkung der CO₂-Emissionen
- Wassereffizienz
- Prozesse zur Reduzierung von Materialabfall
- Vielfalt in der Belegschaft
- Gesundheit und Wohlbefinden
- Angemessene Löhne
- Überwachung der Lieferkette

- Gemeinnütziges Engagement

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 50 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- 90,6 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

- Spezifische Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal adverse impact, „PAI“), nämlich PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- Unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

- Abstimmung über 789 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden.

- Engagement des Portfolios in Best-in-Class-Emittenten, wie laut unternehmenseigenen ESG-Ratings definiert. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 43 %

- AA: 51 %

- A: 6 %

- B: 0 %

- Der Fonds misst 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; 66,48 %

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
Netto-Null-Ausrichtung	61,31%	55,33%	57,41%	50,51%
Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	5,17%	10,10%	20,46%	12,07%

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	176.699,92	97,98%	287.499,37	99,00%	818.684,77	98,78%	1.514.149,99	98,66%
CO ₂ -Fußabdruck insgesamt (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. EUR	246,12	97,98%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität insgesamt (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	773,82	98,79%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,93%	98,79%	2,11%	99,12%	4,54%	98,39%	3,78%	98,66%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,79%	5,67%	98,56%	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,79%	0,00%	99,25%	0,00%	99,07%	0,00%	98,66%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsrats	37,15%	98,79%	37,73%	99,12%	36,50%	98,39%	34,46%	98,66%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	98,79%	0,00%	99,12%	0,00%	98,39%	0,00%	98,66%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu einem der folgenden Punkte leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wurde;
- Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder die Klimaschutzlösungen anbieten. 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.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Umfeld, die geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren. Die Anlageverwaltung benutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung führte auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durch.

PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)

Der Fonds investierte nicht in ein Unternehmen, dessen Hauptgeschäft mit der Gewinnung von fossilen Brennstoffen verbunden ist.

PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken)

Obwohl der Fonds derzeit keine offiziellen Schwellenwerte für Ausschlüsse im Zusammenhang mit der biologischen Vielfalt hat, wurde dieser Aspekt bei der allgemeinen Umwelt- und Klimafolgenabschätzung für Investitionen und potenzielle Investitionen des Fonds berücksichtigt. Der Fonds erwartet, dass alle Unternehmen, in die er investiert, ein positives Profil in Bezug auf die biologische Vielfalt aufweisen. Verstöße können zum Anlageausschluss führen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, gegen die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Vielfalt, Gleichberechtigung und Inklusion auch als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder dem Vertrieb von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Antipersonenminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen, Streumunition, weißer Phosphor).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	6,70%	USA
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	5,60%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	5,07%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	4,75%	USA
Broadcom Inc	Informationstechnologie	3,89%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	3,61%	USA
JPMORGAN CHASE & CO	Finanzsektor	2,80%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,74%	USA
BANK OF AMERICA CORP	Finanzsektor	2,14%	USA
VISA INC	Finanzsektor	2,11%	USA
NETFLIX INC	Kommunikationsdienste	2,11%	USA
MORGAN STANLEY	Finanzsektor	1,92%	USA
Linde PLC	Grundstoffe	1,91%	USA
Home Depot Inc/The	Zyklische Konsumgüter	1,85%	USA
VULCAN MATERIALS CO	Grundstoffe	1,79%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

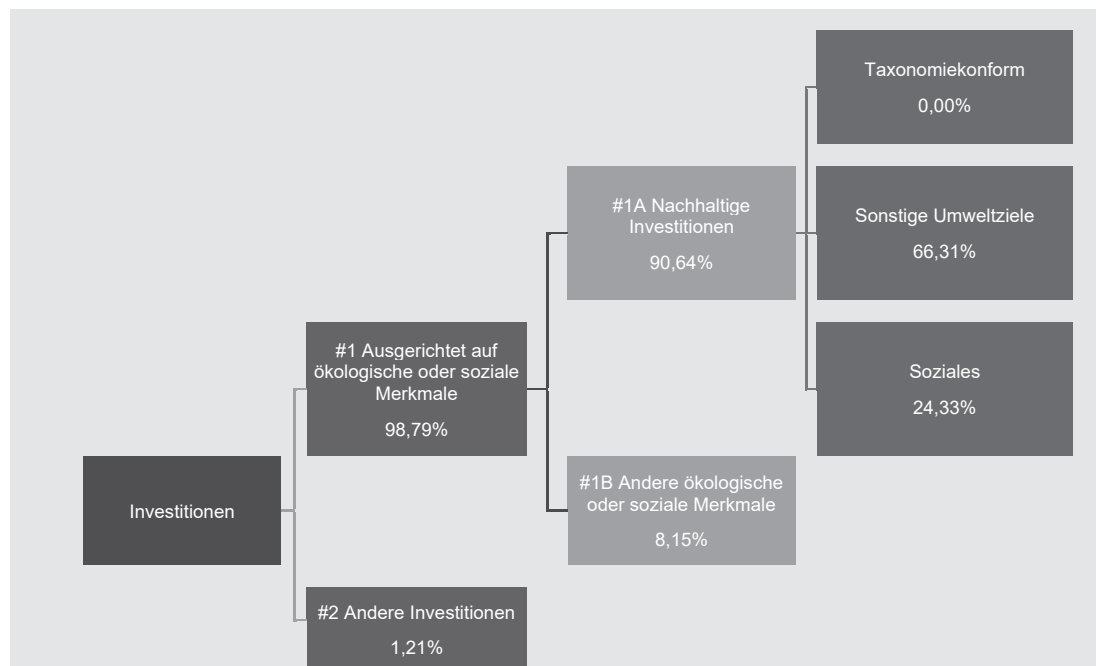
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 90,64 %.

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, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 90,64 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	98,79%	99,25%	99,83%	98,66%
#2 Andere Investitionen	1,21%	0,75%	0,17%	1,34%
#1A Nachhaltige Investitionen	90,64%	84,13%	85,40%	81,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	8,15%	15,12%	14,43%	17,66%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	66,31%	55,38%	55,60%	48,00%
Soziales	24,33%	28,75%	29,80%	33,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	30,43%
Finanzsektor	13,31%
Industrie	12,72%
Gesundheitssektor	9,96%
Zyklische Konsumgüter	9,93%
Kommunikationsdienste	7,72%
Grundstoffe	4,96%
Basiskonsumgüter	4,49%
Versorgungsunternehmen	2,64%
Immobilien	2,63%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	12,89%
Software	12,01%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	5,07%
Banken	4,94%
Allgemeiner Einzelhandel	4,75%
Fachhandel	4,32%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,95%
Unterhaltung	3,77%
Kapitalmärkte	3,62%
Chemische Erzeugnisse	3,16%
Pharmaindustrie	3,05%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,70%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,70%
Versicherungen	2,64%
Maschinen	2,43%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

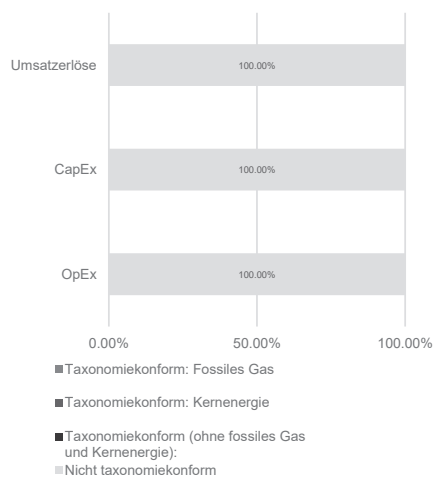
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

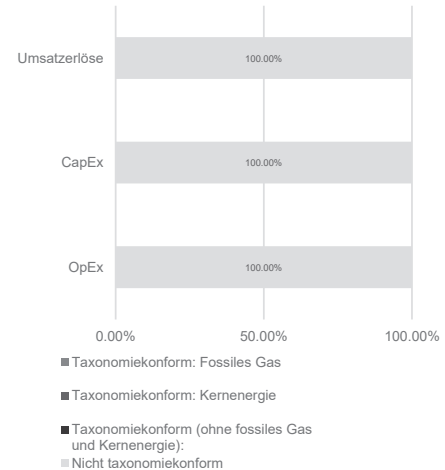
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio mit Stand vom 28.02.2026 zu 66,31 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 24,33 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „Nr. 2 Andere Investitionen“ betrug 1,21 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um führende Unternehmen beim Thema Nachhaltigkeit zu identifizieren, darunter ein Screening im Hinblick auf gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Anlageverwaltung betrachtet AAA und AA als „Best-in-Class“. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 43 %
- AA: 51 %
- A: 6 %
- B: 0 %

1. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

2. Im Hinblick auf die folgenden Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Fossile Brennstoffe
- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Konventionelle Waffen
- Kernkraft
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

3. 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.

4. Die Anlageverwaltung hielt das ESG-Rating des Portfolios fortlaufend über dem Anlageuniversum des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge Global Growth Leaders Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300S2ND6DHQ60NF78



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 56,08% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale waren wesentliche Umwelt-, Sozial- und Governance- (ESG) Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Wirtschaftszweig, in dem das Unternehmen tätig ist, als wesentlich gelten. Dazu gehörten unter anderem Gesundheit und Sicherheit, Geschlechtervielfalt, Klimarisiko, Corporate-Governance-Risiko und Datensicherheit.

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 50 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- 56,08 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

sozialen Merkmale erreicht werden.

Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

· Spezifische PAI-Indikatoren, nämlich: PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

· Unternehmenseigene Methoden, um die Fortschritte der Meetings im Rahmen des ESG-Engagements der Anlageverwaltung zu bewerten. ClearBridge hielt mit seinen Portfoliounternehmen regelmäßig Meetings zum Thema ESG-Engagement ab. Die Ansichten des Investment-Teams zu Fortschritten, die im Zuge dieser Meetings diskutiert wurden, spiegeln sich in den unternehmenseigenen ESG-Ratings, den Entscheidungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider.

· Abstimmung über 1235 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden.

· Portfolio-Risikopositionen in Best-in-Class-Unternehmen laut Festlegung im eigenen ESG-Rating der Anlageverwaltung. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 19 %

AA: 65 %

A: 15 %

B: 0 %

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	105.692,42	98,72%	3.459,70	97,80%	1.144,23	97,96%	1.295,82	96,85%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	991,25	98,72%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	1.379,88	98,88%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Exponiertheit gegenüber Unternehmen mit Aktivitäten in fossilen Brennstoffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	4,62%	98,95%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,03%	0,00%	98,50%	0,00%	98,03%	0,00%	98,22%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsrates	34,24%	99,03%	34,90%	98,26%	35,99%	97,20%	36,36%	95,59%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	99,03%	0,00%	98,26%	0,00%	97,20%	0,00%	95,59%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds werden in Aktien von Unternehmen getätigt, die zu einem der folgenden Bereiche beitragen:

- Unternehmen, die durch ihre Waren und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitragen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wurde;

- 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.

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele müssen die Unternehmen eine eigene Bewertung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung durchlaufen und die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm) erfüllen, wie weiter unten beschrieben.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen, sozialen und Aspekten im Hinblick auf die Unternehmensführung integriert.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Management-Teams und andere Faktoren.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Die Anlageverwaltung kann auch Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)

Der Fonds investierte gemäß den verbindlichen Elementen nicht in ein Unternehmen, dessen Hauptgeschäft mit der Gewinnung von fossilen Brennstoffen verbunden ist. Der Fonds kann in geringem Umfang in Unternehmen investieren, die in der Wertschöpfungskette für fossile Brennstoffe tätig sind (dies spiegelt sich in PAI Nr. 4 wider).

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	5,67%	USA
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	4,23%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	3,51%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	3,46%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	3,08%	USA
Broadcom Inc	Informationstechnologie	2,66%	USA
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	2,44%	Taiwan
Meta Platforms Inc	Kommunikationsdienste	2,11%	USA
DOLLARAMA INC	Zyklische Konsumgüter	1,77%	Kanada
HDFC BANK LTD	Finanzsektor	1,74%	Indien
COSTCO WHOLESALE CORP	Basiskonsumgüter	1,72%	USA
Siemens Energy AG	Industrie	1,65%	Deutschland
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienste	1,59%	China
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	Finanzsektor	1,48%	USA
Eli Lilly & Co	Gesundheitssektor	1,47%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

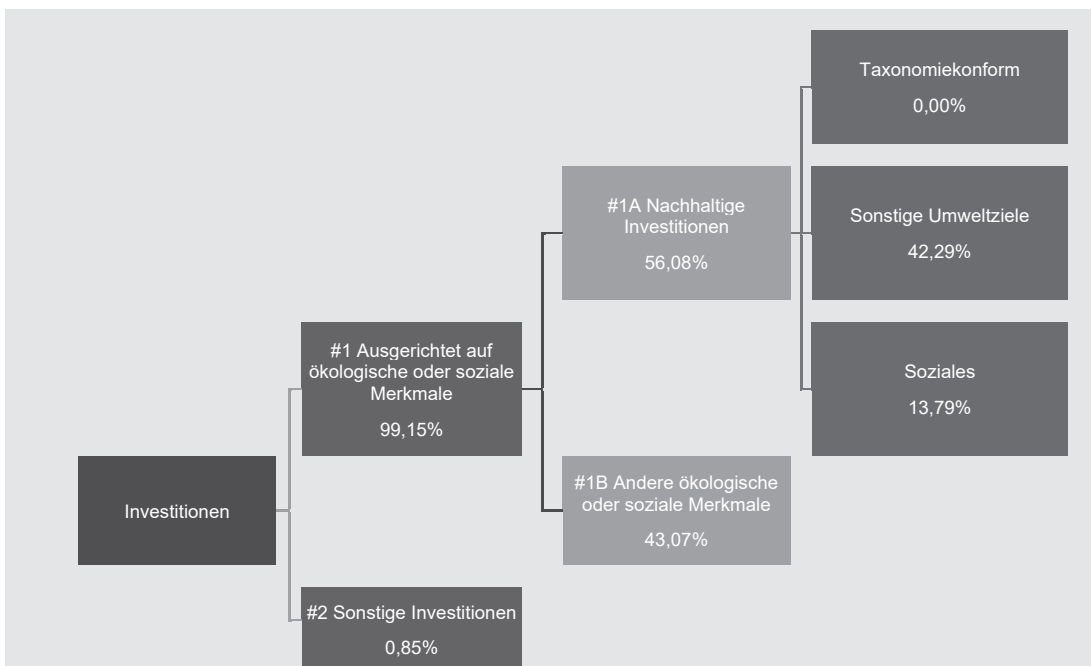
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 56,08 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,15 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,85 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 56,08 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,15%	99,21%	98,32%	98,22%
#2 Sonstige Investitionen	0,85%	0,79%	1,68%	1,78%
#1A Nachhaltige Investitionen	56,08%	50,24%	63,60%	59,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	43,07%	48,97%	34,72%	39,22%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	42,29%	44,59%	45,00%	38,00%
Soziales	13,79%	5,65%	18,60%	21,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	28,41%
Finanzsektor	15,56%
Kommunikationsdienste	12,47%
Zyklische Konsumgüter	12,33%
Industrie	11,25%
Gesundheitssektor	10,92%
Basiskonsumgüter	7,44%
Versorgungsunternehmen	0,40%
Immobilien	0,23%
Grundstoffe	0,15%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	12,66%
Banken	10,53%
Software	10,27%
Allgemeiner Einzelhandel	7,59%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,31%
Elektrogeräte	4,66%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	4,34%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	3,89%
Unterhaltung	3,59%
Pharmaindustrie	3,47%
Biotechnologie	2,92%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,83%
Kapitalmärkte	2,71%
Baustoffe	2,21%
Getränke	1,67%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

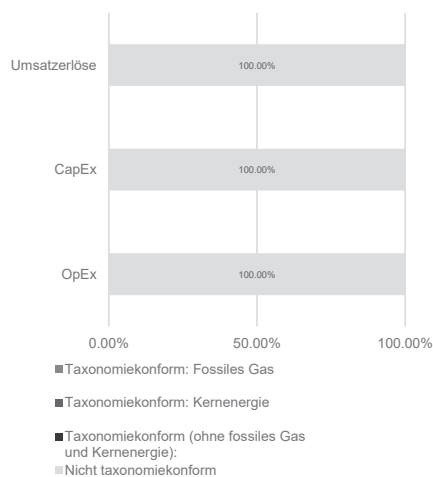
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

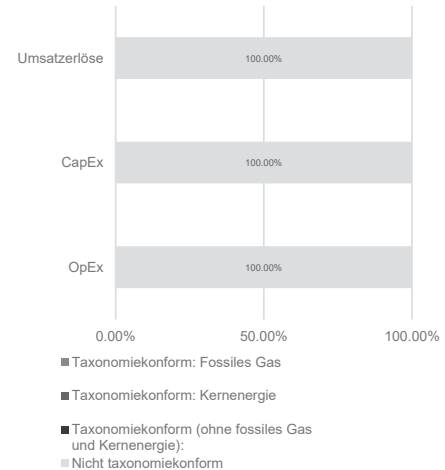
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 42,29 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 13,79 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,85 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter ein Screening guter Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 19 %

AA: 65 %

A: 15 %

B: 0 %

1. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog und intervenierte auch bei den nach verwaltetem Vermögen und Anzahl der Emittenten untersten 10 % des Portfolios (basieren auf dem unternehmenseigenen ESG-Ratingsystem der Anlageverwaltung). Das ESG-Engagement bei ClearBridge hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu Engagement und Verantwortung: <https://franklintempletonprod.widen.net/content/qz5ty08kfn/original/engagementstewardshipolicy.pdf>

2. Im Hinblick auf die folgenden Industrien investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Tabak
- Umstrittene Waffen
- Unternehmen, die stark in die Förderung und/oder Herstellung fossiler Energieträger und in den Bergbau involviert sind.

3. Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen einen oder mehrere der zehn Grundsätze in den vier UNGC-Themenbereichen (Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsprävention) verstoßen.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge Infrastructure Value Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300C63RJNQRH38W57



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 57,96% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte eine positive Wirkung im Hinblick auf:

- Klimaschutz
- Anpassung an den Klimawandel und/oder
- gesellschaftliche Auswirkungen

Die Unterstützung positiver Wirkungen in den oben genannten Bereichen führte dazu, dass der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Referenzzeitraum förderte:

- Investitionen, die den Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft unterstützen, entweder durch direkte Reduzierung von Emissionen, Ermöglichung von Alternativen mit weniger Emissionen oder Bereitstellung von Ersatzprodukten mit geringeren Emissionen, oder durch Dienstleistungen für den Transport auf der Schiene statt Alternativen per Flugzeug oder auf der Straße
- Investitionen in Infrastrukturunternehmen, die die Anpassung an den Klimawandel unterstützen
- Infrastruktur, die gesellschaftliche Auswirkungen unterstützt, wie die Bereitstellung eines gerechten Zugangs zu grundlegenden Dienstleistungen wie Zugang zu Wasser, Energie und Kommunikation, und
- Einhaltung der Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien („ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

Die Anlageverwaltung wendet ihren ESG-Prozess auf alle Anlagen im Berichtszeitraum an. Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 15 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, betrug 57,96 % und
- das ESG-Rating des Fonds (7,38) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,72), wie in der Tabelle unten ersichtlich.

Dort, wo die ESG-Punktzahlen auf MSCI-Daten beruhen, sind sie gleichgewichtet mit dem „ESG-Rating des Anlageuniversums“ und der Portfoliogewichtung für das „ESG-Rating des Fonds“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums unter Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft. Das „investierbare Anlageuniversum“ des Fonds besteht aus 200 Aktien aus dem Infrastrukturbereich, die zusammen als RARE200 bezeichnet werden. Diese werden im Rahmen des Anlageprozesses vierteljährlich überprüft.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
	Wert	Wert	Wert	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,38	7,41	7,35	7,31
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,72	6,67	6,58	6,45

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	416.158,69	96,40%	336.618,28	97,72%	376.657,11	97,18%	319.510,77	92,41%
CO ₂ -Fußabdruck insgesamt (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. EUR	453,63	96,40%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität insgesamt (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	1.980,37	96,40%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil an der Gesamtenergie	76,98%	49,01%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,40%	0,00%	97,72%	0,00%	97,18%	0,00%	95,98%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,40%	0,00%	97,72%	0,00%	95,77%	0,00%	92,41%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2025 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds für Investitionen in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitrugen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassten:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbare Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert
- Wasserversorger, die die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleisten
- Kommunikationsinfrastruktur, die eine Alternative zum Verkehr bietet und gleichzeitig durch Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen gesellschaftliche Wirkung erzielen kann

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Waren und Dienstleistungen
- 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.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilsektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen ihres Bottom-up Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Jeder Infrastruktur-Teilsektor wurde anhand einer Gewichtung der für seinen Geschäftsbetrieb relevanten Faktoren bewertet. Die Steuerung von THG-Emissionen im Unternehmen einschließlich glaubhafter Reduktionspläne wird auch als Teil dieses Prozesses betrachtet.

PAI Nr. 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihres Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist. In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen. Er wird von spezifischen EU-Kriterien begleitet. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen. 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.

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.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
SEVERN TRENT PLC	Versorgungsunternehmen	4,96%	Vereinigtes Königreich
Ferrovial SE	Industrie	4,76%	Niederlande
ENTERGY CORP	Versorgungsunternehmen	4,71%	USA
SSE PLC	Versorgungsunternehmen	4,44%	Vereinigtes Königreich
VINCI SA	Industrie	4,19%	Frankreich
TC Energy Corp	Energie	4,08%	Kanada
NEXTERA ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	4,02%	USA
Getlink SE	Industrie	3,42%	Frankreich
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT SERVICES WORLDWIDE	Industrie	3,36%	Deutschland
CENTERPOINT ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	3,22%	USA
Aena SME SA	Industrie	3,20%	Spanien
E.ON SE	Versorgungsunternehmen	3,12%	Deutschland
WEC ENERGY GROUP INC	Versorgungsunternehmen	2,92%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

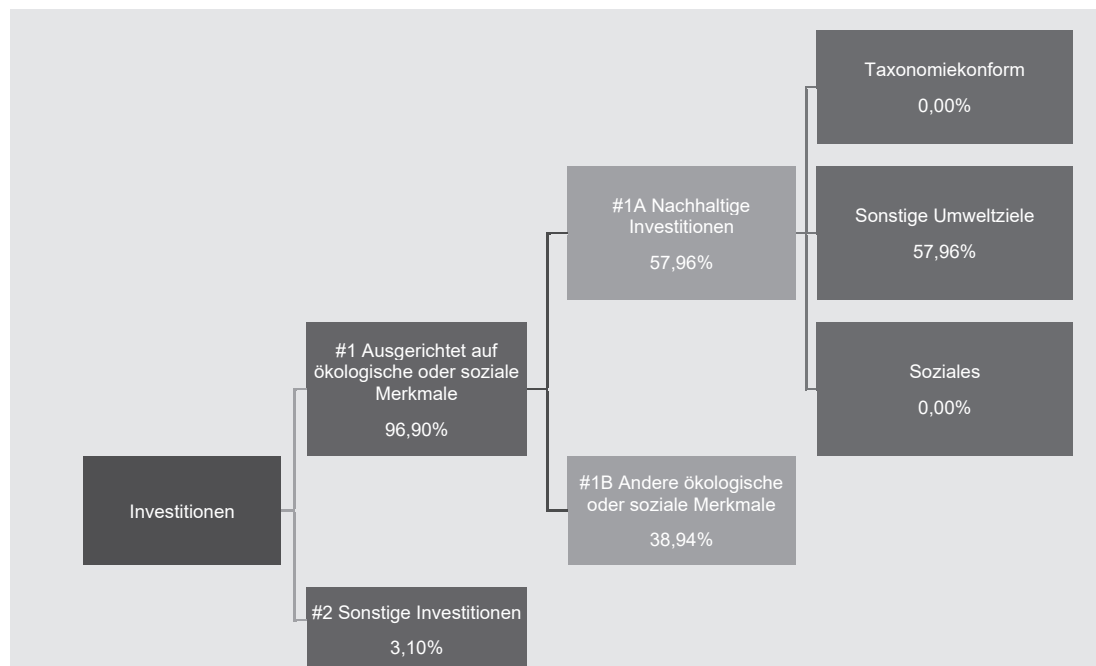
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 57,96 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,90 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,10 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 57,96 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,90%	97,72%	98,55%	95,98%
#2 Sonstige Investitionen	3,10%	2,28%	1,45%	40,20%
#1A Nachhaltige Investitionen	57,96%	55,65%	61,70%	57,35%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	38,94%	42,07%	36,85%	38,63%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	57,96%	55,65%	61,70%	57,35%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	57,18%
Industrie	29,26%
Energie	10,46%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Stromversorger	32,42%
Multi-Versorger	14,37%
Verkehrsinfrastruktur	12,88%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	10,46%
Bau- u. Ingenieurwesen	8,96%
Überlandtransport	7,42%
Wasserversorger	5,68%
Gasversorger	2,48%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	2,24%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

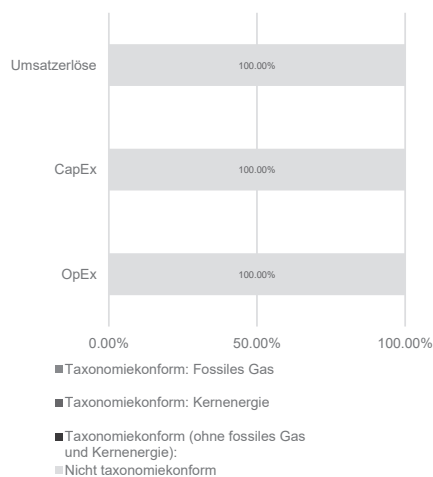
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

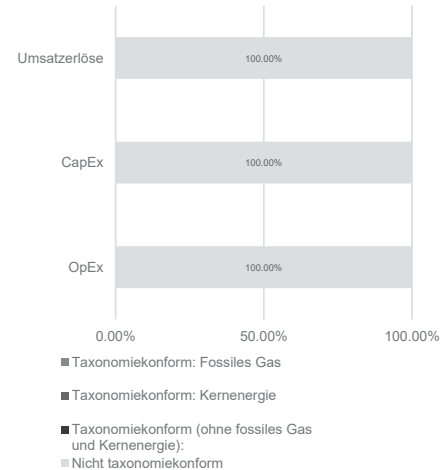
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio mit Stand vom 28.02.2026 zu 57,96 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 3,10 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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.

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen werden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2025 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 13 %
- AA: 87 %
- A: 0 %
- 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.

Die Einzelheiten zum Engagement des Fonds zur Berichterstattung waren wie folgt:

- Umwelt: 67 %
- Soziales: 60 %
- Governance: 80 %

3. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.

4. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge Global Infrastructure Income Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
54930016JDVIT9OWQK33



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, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 53,68% an nachhaltigen Investitionen
 - ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
 - ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte eine positive Wirkung im Hinblick auf:

- Klimaschutz
- Anpassung an den Klimawandel und/oder
- gesellschaftliche Auswirkungen

Die Unterstützung positiver Wirkungen in den oben genannten Bereichen führte dazu, dass der Fonds die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale im Referenzzeitraum förderte:

- Investitionen, die den Übergang zu einer CO₂-armen Wirtschaft unterstützen, entweder durch direkte Reduzierung von Emissionen, Ermöglichung von Alternativen mit weniger Emissionen oder Bereitstellung von Ersatzprodukten mit geringeren Emissionen, oder durch Dienstleistungen für den Transport auf der Schiene statt Alternativen per Flugzeug oder auf der Straße
- Investitionen in Infrastrukturunternehmen, die die Anpassung an den Klimawandel unterstützen
- Infrastruktur, die gesellschaftliche Auswirkungen unterstützt, wie die Bereitstellung eines gerechten Zugangs zu grundlegenden Dienstleistungen wie Zugang zu Wasser, Energie und Kommunikation, und
- Einhaltung der Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)

Bei der Auswahl von Wertpapieren während des Berichtszeitraums verwendete die Anlageverwaltung einen etablierten eigenen Research- und Engagement-Prozess, um das Profil eines Unternehmens in Bezug auf Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien

(„ESG“) zu ermitteln. Aus diesem unternehmenseigenen Verfahren entstand ein ESG-Ratingsystem, das anhand einer Wesentlichkeitskarte gezielt diejenigen ESG-Merkmale identifiziert, die für das Investment relevant sind.

Die Anlageverwaltung wendet ihren ESG-Prozess auf alle Anlagen im Berichtszeitraum an. Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 15 % an „nachhaltigen Anlagen“ ein.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Der Anteil der vom Fonds gehaltenen nachhaltigen Investments, wie sie in der eigenen Methodik nachhaltiger Anlagen der Anlageverwaltung definiert sind, betrug 53,68 % und
- das ESG-Rating des Fonds (7,16) im Vergleich zum ESG-Rating des Anlageuniversums (6,87), wie in der Tabelle unten ersichtlich.

Dort, wo die ESG-Punktzahlen auf MSCI-Daten beruhen, sind sie gleichgewichtet mit dem „ESG-Rating des Anlageuniversums“ und der Portfoliogewichtung für das „ESG-Rating des Fonds“. Zudem weisen wir darauf hin, dass die Wertentwicklung des Fonds das Rating des investierbaren Anlageuniversums unter Berücksichtigung anderer externer Anbieter von ESG-Ratings übertrifft.

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
ESG-Rating des Fonds	7,16	7,57	7,82	7,89
ESG-Rating des investierbaren Anlageuniversums	6,87	6,78	6,67	6,58

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt	tCO ₂ e	125.522,83	94,36%	138.961,75	96,96%	157.590,78	96,86%	139.114,60	96,67%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	418,03	94,36%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	1.925,87	94,36%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil an der Gesamtenergie	64,74%	54,70%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,10%	0,00%	98,17%	0,00%	96,86%	0,00%	98,02%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	95,10%	0,00%	97,57%	0,00%	95,18%	0,00%	94,59%

... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen weitgehend denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Vor dem Hintergrund des Infrastrukturmandats des Fonds zur Investition in Schlüsselinfrastrukturwerte und der wichtigen Rolle, die Infrastruktur bei der Bereitstellung grundlegender Dienstleistungen und des Energiewandels spielt, hielt der Fonds Anlagen, die zu den nachhaltigen Zielen im Zusammenhang mit den Zielen Klimaschutz und/oder Anpassung an den Klimawandel beitrugen und/oder einen positiven sozialen Beitrag leisteten.

Die wichtigsten Beiträge zu den Zielen seitens nachhaltiger Anlagen umfassten:

- Stromversorgungsunternehmen und Unternehmen für erneuerbare Energien, die den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft und somit die Eindämmung des Klimawandels fördern
- Infrastruktur für eine emissionsärmere Mobilität, die den Übergang zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft und damit die Eindämmung des Klimawandels fördert
- Wasserversorger, die die Anpassung an den Klimawandel und die sozialen Auswirkungen unterstützen, indem sie den Zugang zu unentbehrlichem, sauberem und sicherem Wasser gewährleisten
- Kommunikationsinfrastruktur, die eine Alternative zum Verkehr bietet und gleichzeitig durch Zugang zu grundlegenden Dienstleistungen gesellschaftliche Wirkung erzielen kann

All dies wurde zunächst anhand der jeweiligen Beiträge zu einem oder beiden der folgenden Punkte bewertet:

- SDG-Ausrichtung von Waren und Dienstleistungen
- 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.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wesentlichen nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wichtigen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet waren. Dies umfasste auch eine Bewertung in Bezug auf gute Unternehmensführung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Für die Integration von ESG in ihren Anlageprozess verwendete die Anlageverwaltung einen Bottom-up-Research-Ansatz, der viele Datenquellen, darunter auch PAI, nutzt. PAI wurden im Kontext des jeweiligen Infrastruktur-Teilsektors berücksichtigt.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI wurden als Bestandteil des allgemeinen ESG-Prozesses und der Berücksichtigung des DNSH-Prinzips (Do No Significant Harm) der Anlageverwaltung betrachtet. Die ESG-Prozesse, bei denen PAI berücksichtigt wurden, umfassten: (i) die eigene ESG-Punktzahl, (ii) Beobachtung von Kontroversen und laufendes Engagement sowie (iii) qualitative ESG-Erwägungen.

Die folgenden PAI wurden einbezogen:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen ihres Bottom-up Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Jeder Infrastruktur-Teilsektor wurde anhand einer Gewichtung der für seinen Geschäftsbetrieb relevanten Faktoren bewertet. Die Steuerung der THG-Emissionen im Unternehmen einschließlich glaubhafter Reduktionspläne wurde auch als Teil dieses Prozesses betrachtet.

PAI Nr. 5 (Anteil der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)

Die Anlageverwaltung bewertete den Energieerzeugungsmix im Rahmen ihres Bottom-up-Research-Ansatzes, vor allem da sie ein Bestandteil der Ziele Klimawandel und Netto-Null ist.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen. 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.

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.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
ENTERGY CORP	Versorgungsunternehmen	4,80%	USA
ENEL SPA	Versorgungsunternehmen	4,23%	Italien
TC Energy Corp	Energie	4,12%	Kanada
SSE PLC	Versorgungsunternehmen	3,99%	Vereinigtes Königreich
SEVERN TRENT PLC	Versorgungsunternehmen	3,97%	Vereinigtes Königreich
NEXTERA ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	3,68%	USA
VINCI SA	Industrie	3,58%	Frankreich
APA GROUP	Versorgungsunternehmen	3,57%	Australien
Aena SME SA	Industrie	3,43%	Spanien
South Bow Corp	Energie	3,40%	Kanada
E.ON SE	Versorgungsunternehmen	3,37%	Deutschland
ENBRIDGE INC	Energie	3,29%	Kanada
Brookfield Renewable Corp	Versorgungsunternehmen	3,17%	USA
OGE ENERGY CORP	Versorgungsunternehmen	2,93%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

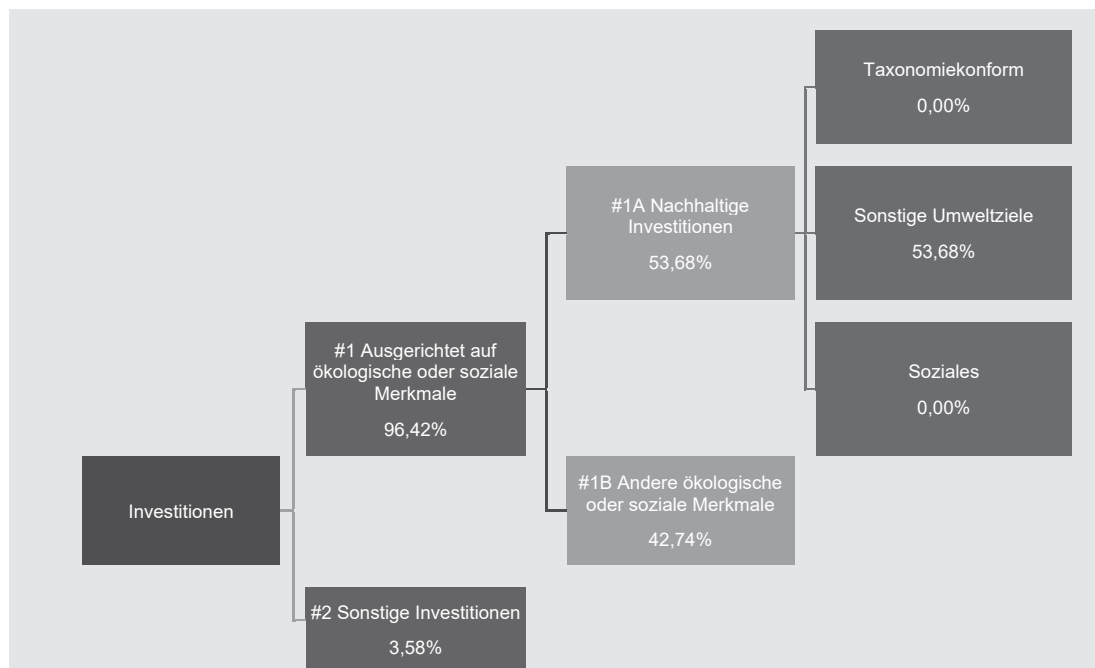
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 53,68 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

96,42 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (3,58 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 53,68 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	96,42%	98,17%	97,37%	98,02%
#2 Sonstige Investitionen	3,58%	1,83%	2,63%	1,98%
#1A Nachhaltige Investitionen	53,68%	54,79%	50,10%	35,52%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	42,74%	43,38%	47,27%	62,50%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	53,68%	54,79%	50,10%	35,52%
Soziales	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel und Derivate) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Versorgungsunternehmen	62,68%
Industrie	16,08%
Energie	16,07%
Immobilien	1,59%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Stromversorger	35,65%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	16,07%
Multi-Versorger	9,31%
Verkehrsinfrastruktur	8,42%
Wasserversorger	6,42%
Gasversorger	6,00%
Unabhängige Produzenten von Strom u. erneuerbarer Elektrizität	5,30%
Überlandtransport	4,08%
Bau- u. Ingenieurwesen	3,58%
Spezialisierte REITs	1,59%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben** (CapEx), die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

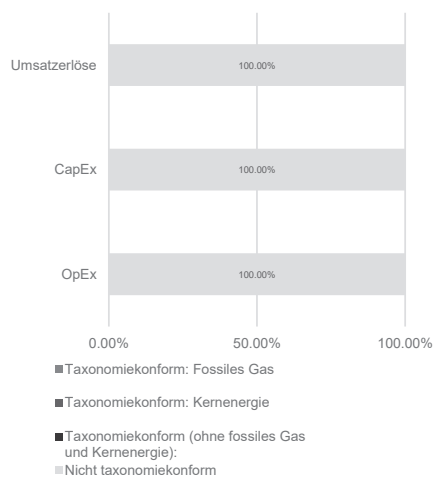
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

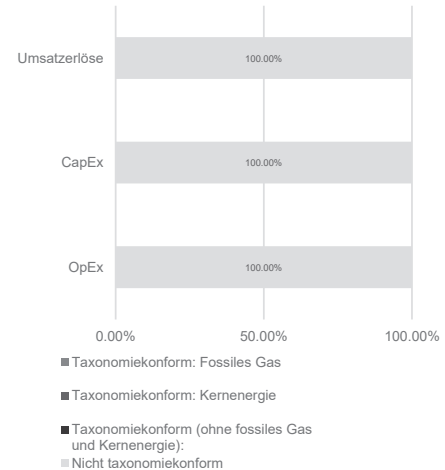
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 53,68 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 3,58 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



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.

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen werden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

- AAA: 13 %
- AA: 81 %
- A: 6 %
- B: 0 %

2. Die Anlageverwaltung stand mit ihren Portfoliounternehmen fortlaufend im Dialog. Das ESG-Engagement der Anlageverwaltung hatte im Allgemeinen zwei sich überlappende Ziele:

- Research: Entwicklung einer besseren Kenntnis von ESG-Kriterien, die sich auf unsere Anlagethese auswirken könnten
- Impact: Förderung spezifischer Veränderungen im Unternehmen, die eine positive Wirkung in der realen Welt haben könnten.

Das Engagement des Fonds im Referenzzeitraum stellt sich wie folgt dar:

- Umwelt: 59 %
- Soziales: 51 %
- Governance: 86 %

3. Im Ergebnis beachtete der Fonds die bindenden Elemente seiner Anlagestrategie.

4. Das ESG-Rating des Fondsportfolios war fortlaufend höher als das des Anlageuniversums des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge Global Value Improvers Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900JA2MNQ8SPZ8938



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 60,34% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Der Fonds förderte während des Berichtszeitraums eine Reihe von ökologischen und sozialen Merkmalen, die die Anlageverwaltung für das jeweilige Unternehmen und die Branche, in der das Unternehmen tätig ist, als wesentlich erachtete. Diese Merkmale umfassten unter anderem:

Umwelt:

- Klimaschutz
- Anpassung an den Klimawandel
- Wasser
- Biologische Vielfalt

Soziales:

- Gesundheit u. Sicherheit
- Geschlechtervielfalt
- Finanzielle Inklusion
- Ernährungssicherheit
- Sauberes Wasser

Zudem hielt der Fonds seine Verpflichtung zu einem Mindestmaß von 10 % an „nachhaltigen Investitionen“ ein.
Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

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:

- 60,3 % des Fonds sind gemäß der unternehmenseigenen Methodik der Anlageverwaltung nachhaltig angelegt. Diese Methodik berücksichtigt unter anderem die Ausrichtung von Waren und/oder Dienstleistungen auf die nachhaltigen Entwicklungsziele der Vereinten Nationen („SDGs“) und die Einhaltung des Grundsatzes der Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen („DNSH“).

- Spezifische Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal adverse impact, „PAI“), nämlich PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität), PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI Nr. 6 (Wassernutzung und Recycling), PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) und PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) wurden berechnet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

- Abstimmung über 623 Agenda-Positionen, in denen Vorschläge zu guter Unternehmensführung und der Verbesserung von Nachhaltigkeitspraktiken unterstützt werden,

- Portfoliobeteiligung an Unternehmen, die sich wissenschaftsbasierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt haben und sich dazu verpflichtet haben (61,87 %)

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich					
		2026		2025		2024	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 3	tCO ₂ e	14.277,55	94,21%	11.729,82	94,38%	5.447,99	91,65%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	2.192,98	94,21%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	3.729,90	94,21%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,43	1,79%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,21%	0,00%	94,38%	0,00%	91,65%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	37,91%	94,21%	37,96%	94,38%	37,73%	91,65%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,21%	0,00%	94,38%	0,00%	91,65%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Die allgemeinen Nachhaltigkeitsindikatoren entsprechen denjenigen des vorangegangenen Berichtszeitraums.

Hinweis: In früheren Berichtszeiträumen waren bestimmte PAIs mit USD als Einheit angegeben. Darin spiegelte sich die Währung wider, die in den zugrunde liegenden Finanzdaten verwendet wurde; dies hatte keinen Einfluss auf die Berechnungsmethode oder die Ergebnisse. Aus Gründen der Kohärenz mit RTS Anhang I wurden 2026 Währungsverweise aus den Angaben zur Einheit gestrichen. Werte aus dem Vorjahr wurden nicht angepasst.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die vom Fonds getätigten nachhaltigen Anlagen erfolgten in Wertpapiere, welche von Unternehmen emittiert wurden, die Beiträge zu mindestens einem der folgenden Bereiche leisteten:

- Unternehmen, die durch ihre Waren und Dienstleistungen zu einem oder mehreren der ökologischen oder sozialen Zielvorgaben der SDG und der ihnen zugrunde liegenden Zielvorgaben und Indikatoren beitrugen, wobei ihr Beitrag mittels der Bewertung der Anlageverwaltung ermittelt wurde;

- Unternehmen mit einer Zielsetzung für die THG-Emissionsintensität und die Emissionsreduzierung in all ihren Wirtschaftstätigkeiten, die durch ein von Dritten verifiziertes Dekarbonisierungsziel im Einklang mit dem Pariser Abkommen festgelegt wird, oder Unternehmen, die Klimaschutzlösungen anbieten.

Zusätzlich zu ihrem Beitrag zu einem der oben genannten ökologischen oder sozialen Ziele wurden die Unternehmen im Rahmen einer eigenen Bewertung der Anlageverwaltung im Hinblick auf eine gute Unternehmensführung beurteilt und erfüllten die DNSH-Kriterien (Do No Significant Harm), wie weiter unten beschrieben.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eine Kombination aus Bewertungen von Drittanbietern für schwerwiegende Risikokontroversen, einem auf globalen Normen basierenden Screening von Drittanbietern, einschließlich der Einhaltung des United Nations Global Compact (UNGC), sowie der Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI*) und anderen wesentlichen Umwelt-, Sozial- und Governance-Faktoren, die in das Fundamentaldaten-Research und den eigenen ESG-Ratingprozess der Anlageverwaltung eingebettet sind. Dies umfasste auch eine Governance-Bewertung, um zu prüfen, ob die Investitionen einem nachhaltigen Anlageziel erheblich schaden.

Zudem nutzte die Anlageverwaltung ihren Dialog mit Portfoliounternehmen zur Ermittlung von Best-in-class-Wertpapieren.

*Die berücksichtigten PAI hingen von der unternehmenseigenen, während des ESG-Ratingprozesses angewandten ESG-Wesentlichkeitsbewertung der Anlageverwaltung nach Teilsektoren bzw. von der Datenverfügbarkeit ab.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde.

Die Art und Weise, in der PAI berücksichtigt wurden, wird im Folgenden näher erläutert.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Die Anlageverwaltung unterstützt die Prinzipien des UNGC. Daher investierte der Fonds nicht in Unternehmen, die gegen eines der zehn Prinzipien in den einzelnen vier Bereichen (Menschenrechte, Arbeit, Umwelt und Korruptionsbekämpfung) des UNGC verstießen.

Die Anlageverwaltung nutzte einen externen Datenanbieter, der die Einhaltung der UNGC-Prinzipien überwachte. In Fällen, in denen es Diskrepanzen oder Unstimmigkeiten zwischen dem Research der Anlageverwaltung und der Einschätzung des Anbieters zu einer bestimmten Kontroverse gab, befragte die Anlageverwaltung zusammen mit dem Compliance-Team und Mitgliedern des ESG-Teams das Unternehmen zu diesem Thema. Wo die Anlageverwaltung zu dem Schluss kam, dass das Unternehmen die notwendigen Schritte unternommen hat, um die Kontroverse zu lösen, oder das Problem effektiv behoben hat, gab die Anlageverwaltung eine detaillierte Erklärung ab, aus der hervorgeht, weshalb weiterhin in das Unternehmen investiert werden kann.

Zur Sicherstellung, dass nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen vereinbar sind, bediente sich die Anlageverwaltung eines Drittanbieters, um die Einhaltung und mögliche Verstöße so gut wie möglich zu überwachen.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Sämtliche PAIs, die für das bewertete Unternehmen von Bedeutung waren, wurden im Rahmen des ESG-Ratings der Anlageverwaltung berücksichtigt, das als Teil des Wertpapierauswahlprozesses angewandt wurde, insbesondere:

PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), PAI Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck), PAI Nr. 3 (THG-Emissionsintensität)

Die Anlageverwaltung bewertete im Zuge ihres Prozesses zur Auswahl von Wertpapieren die speziellen, auf das Klima bezogenen Risiken und Chancen, denen sich das Unternehmen gegenüber gestellt sah. In diesem Auswahlprozess wurden die Überlegungen zu ökologischen und sozialen Aspekten und Faktoren im Hinblick auf die Unternehmensführung einbezogen.

Die Anlageverwaltung prüfte jede Branche anhand einer Reihe spezifischer und für die Geschäftstätigkeit relevanter Kriterien. Allerdings umfasste die Prüfung generell auch eine sorgfältige Betrachtung klimabezogener Faktoren wie: regulatorisches/politisches Umfeld, geografische Lage der Vermögenswerte und Geschäfte, die Fähigkeit, Kosten an die Kunden weiterzugeben, technologische Alternativen und Fortschritte, sich ändernde Kundenpräferenzen, Rohstoffpreise, künftige Investitionsausgaben und F&E-Pläne, die langfristige Geschäftsstrategie, die allgemeine Qualität des Managementteams und andere Faktoren.

Die Anlageverwaltung nutzte zudem MSCI Carbon Portfolio Analytics, um die Verwendung von Reserven fossiler Brennstoffe durch Unternehmen zu bewerten. Die Anlageverwaltung analysierte die gesamte Kohlenstoffintensität der Investitionen des Unternehmens, um die Kohlenstoffintensität aller Vermögenswerte des Unternehmens im Vergleich zu den globalen Aktienmärkten zu erfassen. Zudem konnte die Anlageverwaltung Analysen zur Kohlenstoffintensität auf Portfolioebene durchführen.

PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD)

Siehe: „Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang?“

PAI Nr. 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen)

Die Anlageverwaltung verwendet Daten Dritter für die Überwachung der Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen. Darüber hinaus sieht die Stimmrechtspolitik der Anlageverwaltung vor, im Einzelfall über die Mitglieder und den Vorsitzenden des Nominierungsausschusses zu stimmen, wenn das Unternehmen nicht mindestens ein weibliches oder ethnisch diverses Vorstandsmitglied hat. Die Anlageverwaltung betrachtete Diversität als Bestandteil ihrer ESG-Analyse und -Bewertung sowie als unternehmensweites Thema für das Engagement in Unternehmen.

PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)

Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretninen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	Finanzsektor	4,75%	Spanien
WELLS FARGO & CO	Finanzsektor	4,27%	USA
CHARLES SCHWAB CORP	Finanzsektor	4,05%	USA
SIEMENS AG	Industrie	3,51%	Deutschland
HITACHI LTD	Industrie	3,44%	Japan
EQT CORP	Energie	3,36%	USA
TOTALENERGIES SE	Energie	3,33%	Frankreich
COMPASS GROUP PLC	Zyklische Konsumgüter	3,33%	Vereinigtes Königreich
NATIONAL GRID PLC	Versorgungsunternehmen	3,32%	Vereinigtes Königreich
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitssektor	3,30%	Vereinigtes Königreich
Siemens Energy AG	Industrie	3,25%	Deutschland
UNILEVER PLC	Basiskonsumgüter	3,12%	Vereinigtes Königreich
NEXANS SA	Industrie	3,02%	Frankreich
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	2,85%	USA
NEXTERA ENERGY INC	Versorgungsunternehmen	2,77%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

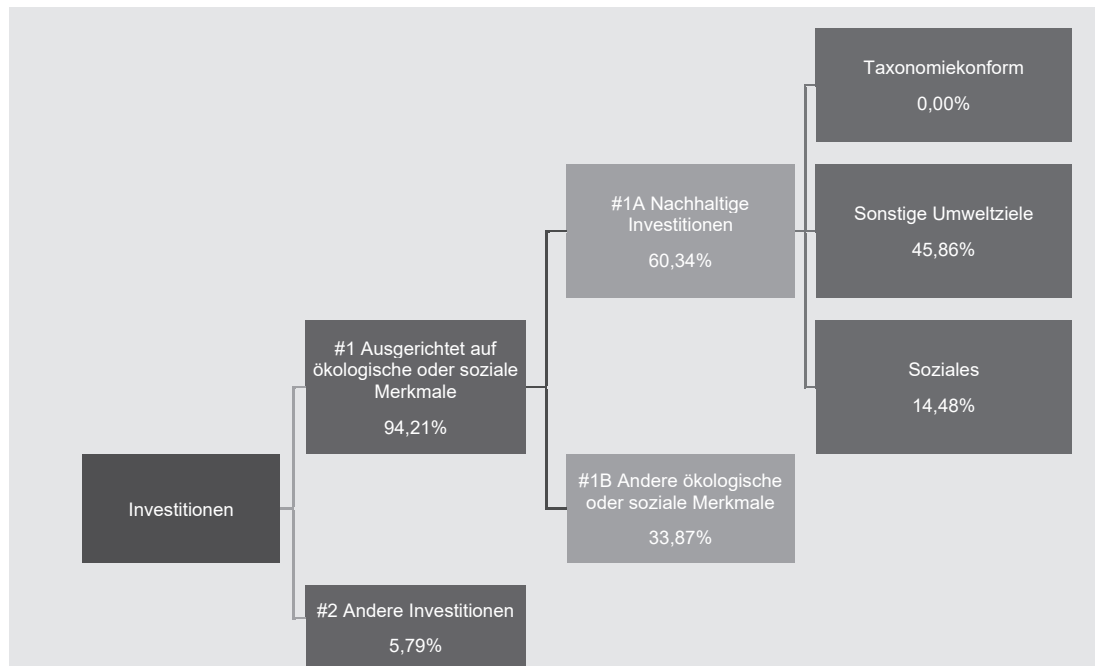
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 60,34 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

94,21 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (5,79 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment des Fonds, das an den beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 60,34 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich		
	2026	2025	2024
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	94,21%	94,38%	92,40%
#2 Andere Investitionen	5,79%	5,62%	7,60%
#1A Nachhaltige Investitionen	60,34%	46,71%	46,80%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	33,87%	47,67%	45,60%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	45,86%	34,31%	32,20%
Soziales	14,48%	12,40%	14,60%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Industrie	23,35%
Finanzsektor	23,29%
Gesundheitssektor	12,42%
Versorgungsunternehmen	8,38%
Energie	6,70%
Kommunikationsdienste	5,59%
Basiskonsumgüter	5,29%
Informationstechnologie	3,67%
Zyklische Konsumgüter	3,33%
Grundstoffe	2,19%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	13,49%
Pharmaindustrie	7,79%
Elektrogeräte	7,73%
Industriekonzerne	6,95%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	6,70%
Baustoffe	4,39%
Kapitalmärkte	4,05%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	3,51%
Produkte für den persönlichen Bedarf	3,48%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	3,33%
Multi-Versorger	3,32%
Finanzdienstleistungen	3,02%
Stromversorger	2,77%
Versicherungen	2,73%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,65%

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 Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

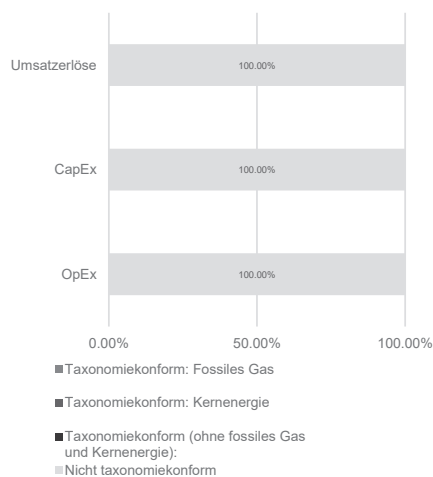
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

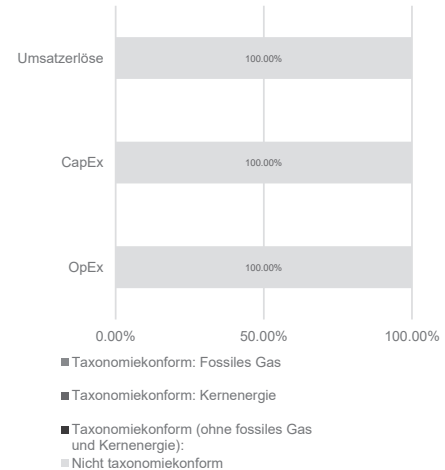
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio mit Stand vom 28.02.2026 zu 45,86 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 14,48 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 5,79 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel und zur Absicherung gehaltene Derivate sowie Derivate ohne ökologische oder soziale Mindestschutzstandards.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Im Hinblick auf die folgenden Branchen investierte der Fonds nicht in die im Prospekt genannten festgesetzten Umsatzschwellen:

- Konventionelle und umstrittene Waffen
- Tabak
- Glücksspiel
- Erwachsenenunterhaltung

1. Die Anlageverwaltung benutzte ihr eigenes Ratingsystem sowie Fundamentaldaten-Research, um zu beurteilen, wie ein Unternehmen seine ESG-Risiken und -Chancen steuerte, darunter gute Unternehmensführung. Das ESG-Ratingsystem bestand aus vier Bewertungsstufen: AAA, AA, A und B. Den Unternehmen wurden diese Bewertungen auf Grundlage ihrer Nachhaltigkeitsstrategie und der Performance im Hinblick auf ESG-Schlüsselkriterien zugeordnet. Alle Unternehmen im Fonds erhielten ein Rating. Die Ratingverteilung des Fonds per 28. Februar 2026 stellt sich wie folgt dar:

AAA: 28 %

AA: 51 %

A: 21 %

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.

Die Anlageverwaltung trat im Kalenderjahr mit mindestens 50 % der im Portfolio enthaltenen Unternehmen und zahlreichen weiteren Emittenten in einen aktiven Dialog.

3. 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.

4. Die Vermögenswerte des Fonds wurden hinsichtlich einer möglichen Verschlechterung oder Verbesserung von ökologischen und sozialen Faktoren verfolgt und überwacht.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
549300Y8TPNIB3NAMF62



FRANKLIN
TEMPLETON

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 68,10% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen, investierte der Fonds in Unternehmen mit den folgenden Merkmalen:

- die ihren CO₂-Ausstoß reduzieren und kontrollieren,
- mit begrenztem oder gar keinem Engagement in der fossilen Brennstoffindustrie,
- mit einem Schwerpunkt auf der effizienten Nutzung von Energie und Wasser,
- die die Verschmutzung begrenzen und die Risiken für die Artenvielfalt kontrollieren,
- mit einer guten Erfolgsbilanz bei Menschenrechts- und Arbeitnehmerfragen und
- ohne Engagement in umstrittenen Waffen.

Nicht alle Beteiligungen des Fonds erfüllen notwendigerweise alle diese Merkmale. Diese Faktoren wurden als Teil der Analyse jedes Unternehmens berücksichtigt und in die Investmentanalyse aufgenommen.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt.

Es wurde kein Index als Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie im eigenen Rahmen der Anlageverwaltung auf der Grundlage der Ziele für nachhaltige Entwicklung der Vereinten Nationen (SDGs) definiert, wurden während des Referenzzeitraums durchschnittlich 68,1 % des Fonds in nachhaltigen Investitionen gehalten.

Alle 14 obligatorischen PAI-Indikatoren sowie zwei zusätzliche Indikatoren wurden berücksichtigt und bewertet. Siehe die Werte im Abschnitt „Inwieweit werden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

Am Ende des Berichtszeitraums waren etwa 28 % des Nettoinventarwerts (NIW) des Portfolios in Unternehmen investiert, die wissenschaftsbasierte Ziele auf der Grundlage der Science-Based Targets initiative genehmigt hatten, und 0 % in Unternehmen, die sich dazu verpflichtet haben, sich innerhalb der kommenden zwei Jahre entsprechende Ziele zu setzen.

Im Laufe des Berichtszeitraums intervenierte das Management-Team 50 Mal zu ESG-Themen mit dem Ziel, das Verhalten von Unternehmen zu beeinflussen. Dabei wurden Themen wie die Unabhängigkeit der Leitungs- und Kontrollgremien, die Pläne der Unternehmen für den Übergang zu netto Null CO₂-Emissionen und Datensicherheit besprochen. Gegen Ende des Jahres befanden sich diese Kontakte auf dem Weg zu deren Abschluss in den unten dargelegten Phasen.

Zudem stützte sich die Anlageverwaltung auf externe Daten (z. B. MSCI) wie unter anderem den CO₂-Fußabdruck und ESG-Scores, ihr internes Research (mit CO₂-Kostenanalyse und Risikofaktoren für moderne Sklaverei) als Input für ihre Analyse und die eigenen internen Ratings für Governance und Nachhaltigkeitsrisiko. Diese dienten als Grundlage für die Titelauswahl, Ausschlüsse und den Engagement-Prozess.

Wir haben die Unternehmen anhand unserer internen Kategorisierung für die Ausrichtung an Netto-Null-Zielen in verschiedene Gruppen eingestuft. Dabei wird berücksichtigt, ob Unternehmen sich wissenschaftlich fundierte Ziele für die Reduzierung von Treibhausgasemissionen gesetzt bzw. sich dazu verpflichtet haben oder Lösungen zum Thema Klima anbieten. Bei diesem Fonds ergibt sich die folgende Verteilung des Portfolios auf diese Kategorien:

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2026	
Wert		
Interventionen: 1. Maßnahmenplan entwickelt	32,00%	
Interventionen: 2. Frage an das Unternehmen gestellt und Unternehmen hat Risiko anerkannt	45,00%	
Interventionen: 3. Unternehmen hat glaubwürdige Strategie zur Bewältigung des Risikos entwickelt	16,00%	
Interventionen: 4. Unternehmen hat Strategie zur Bewältigung des Risikos umgesetzt	8,00%	
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel: Netto-Null-Ausrichtung	31,10%	
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel: Ziel, aber keine Netto-Null-Ausrichtung	58,10%	
Ausrichtung auf Netto-Null-Ziel: Verpflichtung, ein auf Netto-Null ausgerichtetes Ziel festzulegen	0,00%	
Kein Ziel	10,90%	

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Emissionen insgesamt (EUR)	tCO ₂ e	9.282,49	97,00%	8.203,74	97,07%	11.584,46	97,41%	11.085,00	96,39%
CO ₂ -Fußabdruck (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	474,44	97,00%	268,01	97,07%	362,44	97,41%	329,97	96,39%
THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	1.710,80	97,00%	753,27	97,07%	912,40	97,32%	1.004,71	96,39%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	2,32%	96,56%	4,22%	96,74%	6,87%	97,20%	7,95%	96,39%
Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil des Energieverbrauchs aus nicht-erneuerbaren Quellen	83,78%	96,56%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil der Energieerzeugung aus nicht-erneuerbaren Quellen	82,40%	1,65%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,24	1,68%	1,39	96,60%	1,43	81,19%	1,47	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,67	45,81%	0,74	96,60%	1,42	81,19%	3,01	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,46	96,60%	0,52	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	9,44%	0,08	96,60%	0,21	81,19%	0,22	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	96,60%	0,07	81,19%	0,07	87,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	96,60%	0,00	81,19%	0,00	87,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,56%	3,36%	96,74%	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,00	9,20%	0,00	4,97%	0,00	3,34%	0,02	14,67%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,39	96,56%	0,57	95,16%	1,07	47,28%	0,45	50,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,56%	0,00%	96,74%	0,00%	97,38%	0,00%	96,68%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	1,06%	96,56%	0,00%	96,74%	66,13%	97,20%	74,61%	95,98%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches geschlechtsspezifisches Lohngefälle	15,85%	83,18%	18,26%	63,60%	24,15%	8,73%	25,65%	9,73%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsrates	22,60%	96,56%	22,08%	96,74%	19,98%	97,12%	18,30%	96,39%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	96,56%	0,00%	96,74%	0,00%	97,20%	0,00%	96,39%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Mit Wirkung vom 30. September 2025 wurde ClearBridge Investment Management Limited („CIML“) zum Anlageverwalter des Fonds bestellt und der Fonds wurde in FTGF ClearBridge Emerging Markets Fund umbenannt (vormals FTGF Martin Currie Global Emerging Markets Fund). Dementsprechend sind Vergleiche mit Vorjahren unter Umständen nicht aussagekräftig oder überhaupt nicht möglich und werden daher nicht angezeigt. Es gab keine wesentlichen Änderungen der Anlagestrategie, allerdings wurde die Methode für die Messung der Nachhaltigkeitsindikatoren an den Ansatz von ClearBridge angeglichen.

Der Anteil des Fonds-Nettoinventarwerts, der in Unternehmen mit einem wissenschaftsbasierten Ziel investiert ist, stieg per 28. Februar 2026 auf 28 % (gegenüber 20 % per 28. Februar 2025). Im selben Zeitraum ging der Anteil der Unternehmen, die sich zur Festlegung wissenschaftsbasierter Ziele verpflichtet haben, von 8 % auf 0 % zurück. Dies liegt zum Teil daran, dass Unternehmen, die sich zuvor zur Festlegung von Zielvorgaben verpflichtet hatten, nun diesen Schritt vollziehen und ihre Verpflichtungen konkretisieren, zum Teil sind auch Portfolio-Umschichtungen dafür verantwortlich.

Die Zahl der Interventionen in der frühen Phase hat zugenommen, während die Zahl der Interventionen in der späten Phase zurückgegangen ist. Dies ist darauf zurückzuführen, dass wir kontinuierlich Gespräche mit unseren Portfoliounternehmen über wichtige Fragen führen und einige davon nun erfolgreich zum Abschluss gekommen sind.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten Aktien von Unternehmen, die durch ihre Produkte oder Dienstleistungen zu den ökologischen oder sozialen Zielen einer relevanten Untergruppe der 17 Ziele für nachhaltige Entwicklung (SDG) beitrugen.

● Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Zusätzlich zur Identifizierung potenzieller nachhaltiger Investitionen durch die Zuordnung von Unternehmen zu einer bestimmten Untergruppe von Zielen der SDG, wie oben beschrieben, wurden potenzielle Unternehmen, in die investiert werden soll, einer Bewertung anhand des DNSH-Grundsatzes durch die Anlageverwaltung unterzogen. Dies geschah auf zwei Arten:

1. Durch eine Bewertung der Einhaltung globaler Normen auf der Grundlage der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) sowie von Kontroversen im Zusammenhang mit den anderen Umweltaspekten der PAI-Indikatoren.
2. Durch eine Bewertung des DNSH-Prinzips in Bezug auf durch den Klimawandel bedingte Faktoren, die von den PAI-Indikatoren hervorgehoben werden, einschließlich Bereichen wie der Verbindung des Unternehmens zur Gewinnung fossiler Brennstoffe und einem hohen und nicht kontrollierten CO₂-Fußabdruck in einer Branche mit hohem Schadstoffausstoß.

Bei der Bewertung von DNSH im Zusammenhang mit dem Klimawandel berücksichtigte die Anlageverwaltung auch die Art der Geschäftstätigkeit eines Unternehmens sowie das Vorhandensein von Kontroversen oder bestimmten Signalen auf Grundlage der PAI-Indikatoren. Für jede Gruppe von PAI-Indikatoren bewertete die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der einzelnen PAI-Indikatoren und das Vorhandensein potenzieller erheblicher Beeinträchtigungen. Diese Bewertung erfolgte anhand eigener Analysen. Die Ergebnisse der DNSH-Bewertung könnten die vom Anlageverwalter zugewiesenen Governance- und Nachhaltigkeitsrisiko-Ratings beeinflussen. Die DNSH-Bewertung ist jedoch als paralleler Prozess zu den Risikoratings konzipiert, um der Verpflichtung zu „nachhaltigen Investitionen“ gemäß der SFDR nachzukommen. Das wichtigste Ergebnis der DNSH-Bewertung ist die Erkenntnis, ob es Anzeichen für eine erhebliche Beeinträchtigung gibt, die eine Anlage von der Einstufung als nachhaltige Investition ausschließen würde.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

-----Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Die Anlageverwaltung berücksichtigte bei der Verwaltung des Fonds alle 14 verpflichtenden PAI-Indikatoren und zwei optionale Indikatoren. Die beiden zusätzlichen Indikatoren waren:

- Umwelt: Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Reduzierung des CO₂-Ausstoßes sowie
- Soziales: Fehlende Menschenrechtsrichtlinien.

Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen. Wo die Anlageverwaltung potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat er mit den Unternehmen in Kontakt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung auch über die PAI-Indikatoren Bericht unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Weitere Informationen darüber, inwiefern die Anlageverwaltung diese Faktoren bei der Analyse der Unternehmen berücksichtigte, finden Sie im Abschnitt unten mit dem Titel: „Werden bei diesem Finanzprodukt die wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“.

-----Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Alle potenziellen nachhaltigen Investitionen, die identifiziert wurden, unterlagen der umfassenderen ESG-Analyse der Anlageverwaltung, die das Management, die Kultur sowie soziale und ökologische Risiken berücksichtigten. Diese Analyse orientierte sich an den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen, und die Anlageverwaltung legte einen zusätzlichen Schwerpunkt auf das Risiko der sozialen Ausbeutung, das sich an den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte orientiert.

Der UNGC (für den der Fonds verbindliche Kriterien hat) legt zehn Prinzipien fest, die ein Mindestmaß an Verantwortung in den Bereichen Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt und Korruptionsbekämpfung vorgeben und sich aus bestehenden Konventionen ableiten.

Es gibt erhebliche Überschneidungen zwischen den Prinzipien des UNGC und den OECD-Leitsätzen. Diese werden durch die UNGC-Prüfung der Anlageverwaltung effektiv erfasst. Wesentliche andere multilaterale Instrumente, die in den Leitsätzen zitiert werden, bilden ebenfalls Bausteine der OECD-Leitsätze, nämlich die Grundprinzipien der ILO (Internationale Arbeitsorganisation) und die Allgemeine Erklärung der Menschenrechte. Diese decken potenzielle Kontroversen im Zusammenhang mit den wichtigsten Säulen der OECD ab: Menschenrechte, Arbeitsnormen, Umwelt, Korruptionsbekämpfung und Verbraucherschutz.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nachhaltigkeitsfaktoren können sich auf die Unternehmen auswirken, in die der Fonds investiert, und die Anlageverwaltung erkennt auch an, dass die Unternehmen selbst negative Auswirkungen haben können, zum Beispiel auf die Umwelt, ihre Mitarbeiter oder das Umfeld, in dem sie tätig sind. Diese negativen Auswirkungen umfassen unter anderem die Erzeugung von Treibhausgasen (THG) Emissionen und andere Formen von Umweltverschmutzung oder potenzielle Verstöße gegen die UNGC. Die Anlageverwaltung berücksichtigte diese Faktoren bei seiner Analyse der Unternehmen, und wo er potenzielle wesentliche negative Auswirkungen feststellte, trat die Anlageverwaltung mit den betreffenden Unternehmen in Kontakt, wie in der Stewardship- und Engagement-Politik der Anlageverwaltung ausführlicher dargelegt. Gemäß den spezifischen Anforderungen der SFDR erstattete die Anlageverwaltung auch Bericht über die PAI-Indikatoren unter Verwendung von Daten, die von den jeweiligen Unternehmen stammen. Falls diese nicht verfügbar waren, wurden Ersatzwerte herangezogen.

Die Analyse der PAI war Bestandteil der Due-Diligence-Prüfung der Anlageverwaltung für jedes Unternehmen. Die Bewertung der 14 verpflichtenden PAI und der beiden optionalen PAI sind in sechs Schlüsselbereiche für die Bewertung der Wesentlichkeit unterteilt. Nicht alle PAI waren für jedes Unternehmen von Bedeutung. Die Anlageverwaltung beurteilte, ob einer der sechs Bereiche für das Unternehmen, in das investiert wurde, von Bedeutung war, und wo dies der Fall war, bezog er diese Bereiche in seine Risikobewertungen, seine Anlagethese und gegebenenfalls in seine geplanten Engagement-Aktivitäten ein.

Die sechs wichtigsten Gruppierungen der PAI lauten wie folgt:

- Treibhausgasemissionen und deren Steuerung (PAI Nr. 1 (THG-Emissionen), Nr. 2 (CO₂-Fußabdruck) und Nr. 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) sowie optionale PAI zu Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung von CO₂-Emissionen),
- Engagement in Unternehmen aus dem Bereich der fossilen Brennstoffe (PAI Nr. 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind)),
- Energie- und Wassereffizienz (PAI Nr. 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) und Nr. 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren)),
- Umweltverschmutzung und Biodiversität (PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), Nr. 8 (Emissionen in Wasser) und Nr. 9 (Anteil gefährlicher Abfälle)),
- Menschenrechte und Arbeitnehmerfragen (PAI Nr. 10-13 (Verstöße gegen Prinzipien des UNGC und die OECD-Leitsätze, fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und OECD-Leitsätze, unbereinigtes geschlechterspezifisches Verdienstgefälle und Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen) sowie als zusätzlicher PAI ein Schwerpunkt auf Unternehmen mit fehlender Menschenrechtspolitik) und
- Engagement in umstrittenen Waffen (PAI Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen)).

In einigen Fällen, wie z. B. bei dem PAI Nr. 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD), hat der Fonds verbindliche Kriterien und wird nicht in Unternehmen investieren, die nach dem UNGC als „durchgefallen“ eingestuft werden. Im Einklang mit der Politik der Anlageverwaltung in Bezug auf kontroverse Waffen wird der Fonds keine Anteile von Unternehmen erwerben, die ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen.

Informationen über PAI zu Nachhaltigkeitsfaktoren finden Sie in der Richtlinie der Anlageverwaltung für verantwortliches Investieren.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	9,63%	Taiwan, Provinz Chinas
TENCENT HOLDINGS LTD	Kommunikationsdienste	7,81%	China
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Informationstechnologie	6,45%	Südkorea
SK Hynix Inc	Informationstechnologie	4,40%	Südkorea
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	Zyklische Konsumgüter	4,04%	Hongkong
HDFC BANK LTD	Finanzsektor	3,90%	Indien
DELTA ELECTRONICS INC	Informationstechnologie	3,78%	Taiwan, Provinz Chinas
MEDIATEK INC	Informationstechnologie	3,19%	Taiwan, Provinz Chinas
ICICI BANK LTD	Finanzsektor	3,14%	Indien
QUANTA COMPUTER INC	Informationstechnologie	2,40%	Taiwan, Provinz Chinas
RELIANCE INDUSTRIES LTD	Energie	2,31%	Indien



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

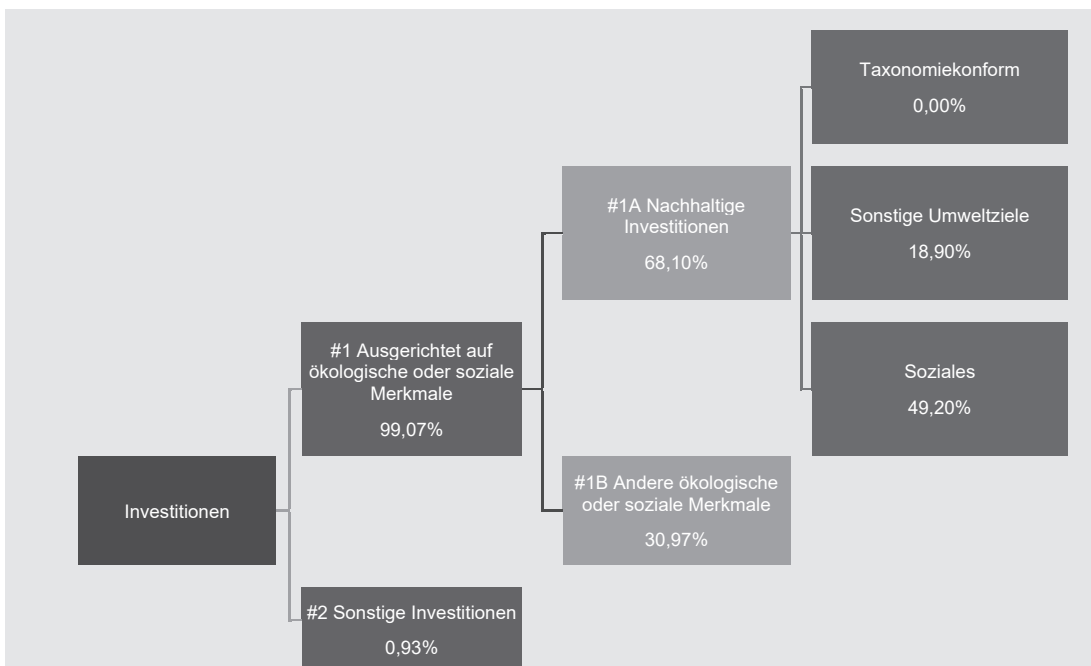
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 68,10 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,07 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,93 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 68,10 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,07%	99,28%	99,12%	97,90%
#2 Sonstige Investitionen	0,93%	0,72%	0,88%	2,10%
#1A Nachhaltige Investitionen	68,10%	67,37%	72,55%	73,00%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	30,97%	31,91%	26,57%	24,90%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	18,90%	16,77%	20,18%	26,00%
Soziales	49,20%	50,60%	52,37%	47,00%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	31,61%
Finanzsektor	25,35%
Zyklische Konsumgüter	13,25%
Kommunikationsdienste	8,63%
Industrie	7,45%
Basiskonsumgüter	3,90%
Gesundheitssektor	3,58%
Grundstoffe	2,98%
Energie	2,31%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	20,77%
Halbleiter u. Halbleiterausüstung	17,22%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	8,85%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	7,81%
Allgemeiner Einzelhandel	5,95%
Elektrogeräte	4,94%
Elektrogeräte, Instrumente und Komponenten	3,78%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	3,17%
Versicherungen	2,82%
Automobilindustrie	2,80%
Nichtzyklische Konsumgüter, Vertrieb und Einzelhandel	2,66%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,32%
Öl, Gas u. nicht-erneuerbare Brennstoffe	2,31%
Textilien, Bekleidung u. Luxusgüter	2,18%
IT-Dienstleistungen	1,76%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

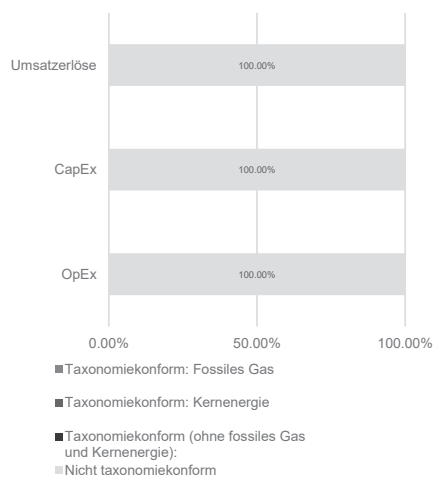
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

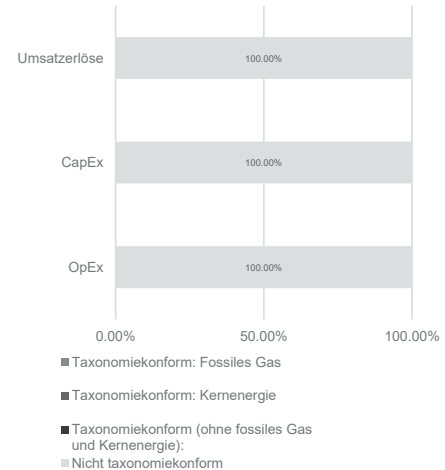
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 18,90 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 49,20 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil von Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 0,93 % und umfasste als Einlagen gehaltene liquide Mittel ohne ökologischen oder sozialen Mindestschutz.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

- Engagement bei Portfoliounternehmen zu Themen wie Unabhängigkeit der Leitungs- und Kontrollgremien, Pläne des Unternehmens zum Übergang auf netto Null CO₂-Emissionen und Datensicherheit.
- Einhaltung der im Prospekt dargelegten Ausschlüsse in Bezug auf unternehmenseigene Ratings zu Governance- und Nachhaltigkeitsrisiken, Verstöße gegen den UN Global Compact, umstrittene Waffen und sonstigen ausgeschlossenen Geschäftsaktivitäten.
- Berücksichtigung aller 14 verbindlichen PAI und von zwei zusätzlichen PAI als Teil der Investmentanalyse, die Indikatoren zur Energie- und Wassereffizienz, Umweltverschmutzung und Risiken für die biologische Vielfalt umfassen.
- Unternehmen mit einem Nachhaltigkeits- oder Governance-Risikoring von 4 oder höher wurden nicht in den Fonds aufgenommen. Die Ratingskala reicht von 1 (geringes Risiko) bis 5 (hohes Risiko).



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

Franklin Responsible Income 2028 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900FTK4TK4QA6CU84



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 18,66% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu fördern hat das Team des Portfoliomanagements Engagements in so genannten „Klima-Nachzüglern“ gemieden. Als „Klima-Nachzügler“ wurden staatliche Emittenten bezeichnet, die bei Umweltfaktoren wie unter anderem Treibhausgasemissionen, Energieintensität, Schutz der Artenvielfalt, Luftverschmutzung und Mix erneuerbarer Energien zu den schlechtesten 20 % ihrer Vergleichsgruppe gehörten. Dabei handelte es sich bei Unternehmensemittenten um Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählten. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Fonds in Klima-Nachzüglern bei 0 % im Referenzzeitraum.

Zudem hat der Fonds nicht in Emittenten investiert, die in umstrittene Geschäftspraktiken oder nachteilige Wirtschaftstätigkeiten verwickelt sind (wie in den vorvertraglichen Informationen näher beschrieben). Dies gilt unter anderem für Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das vom Anlageteam für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (z. B. wird jedes Unternehmen, das mehr als 5 % seines Umsatzes aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielt, für nicht investierbar erachtet). Weitere Beispiele sind Emittenten, die in die Herstellung von Massenvernichtungswaffen verwickelt sind oder Unternehmen, die erheblich und wiederholt gegen den United Nations Global Compact verstoßen. Abgesehen von den aufgeführten Ausschlüssen hat der Fonds auch nicht in staatliche Emittenten investiert, die nach dem Freedom House Index als „nicht frei“ eingestuft werden.

Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines Vermögens in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen (mindestens 10 %), und zu sozialen Zielen (mindestens 1 %) beitragen.

Im Berichtszeitraum vom 3. März 2025 bis 27. Februar 2026 übertraf der Fonds diese Zusagen: In den vier Quartalen war ein gewichteter Durchschnitt von 18,65 % nachhaltig investiert. Davon waren 14,36 % Investments in Aktivitäten, die zu ökologischen Zielen beitragen und 4,30 % in Aktivitäten, die zu sozialen Zielen beitragen. Diese Allokationen erfolgten vor allem mittels Investments

in Anleihen mit vorgegebener Mittelverwendung im grünen, sozialen und/oder nachhaltigen Bereich, die ausdrücklich zur Finanzierung zulässiger Umwelt- und/oder Sozialprojekte emittiert wurden.

Ein Beispiel hierfür ist das Investment des Fonds in eine Anleihe der CaixaBank SA, bei der die Verwendung der Mittel zur Unterstützung von Sozialprojekten vorgegeben war. Die Bank unterstützt soziale und wirtschaftliche Entwicklung durch ihre Finanzierungstätigkeiten, insbesondere die Förderung von Projekten, die zu SDGs beitragen. Die sozialen Investitionen der CaixaBank haben viel bewirkt und kamen insgesamt 10.341.912 Personen zugute: 9.400.000 Einzelpersonen erhielten eine bessere Gesundheitsversorgung, 24.492 profitierten von Bildungsdienstleistungen, 49.699 Arbeitsplätze wurden unterstützt und 22.517 Frauen erhielten gezielte Unterstützung.

In dieser Hinsicht hatte der gewichtete Durchschnitt über die vier Quartale im vorgenannten Berichtszeitraum zur Folge, dass 99,44 % des Fondsvermögens mit den ökologischen und sozialen Merkmalen (E/S) übereinstimmten. Die verbleibenden 0,56 % (ebenfalls auf Grundlage des gewichteten Durchschnitts) waren liquide Mittel und Derivate, die diesen Merkmalen nicht entsprachen.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren wurden angewendet, um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewirbt:

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen Anleihen (GSS-Anleihen) und solchen, die von Umweltchampions begeben wurden.

- 14,36 % Anlagen in grünen Anleihen,
- 4,30 % Anlagen in sozialen Anleihen,
- 0,00 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen,
- 43,43 % Anlagen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden,

Der prozentuale Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, sowie zusätzliche Ausschlüsse, wie im Abschnitt über die Anlagestrategie in diesem Anhang näher beschrieben, betrug 0,00 %.

– Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren) (siehe Tabelle unten).

Die Anlageverwaltung stand zwischen dem 3. März 2025 und dem 27. Februar 2026 mit folgenden Emittenten im Austausch:

1. AIB GROUP PLC
2. AZELIS FINANCE NV
3. BARCLAYS PLC
4. BARRY CALLEBAUT SNCS NV
5. BNP PARIBAS
6. BPCE SA
7. CLOVERIE PLC ZURICH INS
8. CREDIT AGRICOLE SA
9. REPUBLIK FRANKREICH
10. ING GROEP NV
11. ITALMATCH CHEMICALS SPA
12. JPMORGAN CHASE & CO
13. NATWEST MARKETS PLC
14. OTP BANK NYRT
15. PAPREC HOLDING SA
16. PROSUS NV
17. RCI BANQUE SA
18. RUMÄNIEN
19. SKANDINAVISKA ENSKILDA
20. SWEDBANK AB
21. TEAMSYSTEM SPA
22. VOLVO CAR AB

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
Engagement in grünen Anleihen	14,36%	13,24%	11,24%	12,98%
Engagement in sozialen Anleihen	4,30%	5,52%	4,48%	4,59%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Engagement in Umweltchampions	43,43%	36,49%	41,10%	34,59%

	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert	Wert	Wert	Wert
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren)	1,00	1,00	1,00	1,00
Liste der Emittenten, mit denen die Anlageverwaltung zusammenarbeitet	22,00	93,00	1,00	1,00

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1	tCO ₂ e	1.652,43	84,12%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 2	tCO ₂ e	310,82	84,12%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 3 (geschätzt)	tCO ₂ e	17.638,15	85,87%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 1 & 2	tCO ₂ e	1.963,25	84,12%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Gesamtemissionen (geschätzt)	tCO ₂ e	19.601,39	85,87%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
CO ₂ -Fußabdruck 1&2 (EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	31,89	84,12%	57,79	80,21%	57,62	71,04%	53,15	64,71%
CO ₂ -Fußabdruck (Schätzung, EUR)	tCO ₂ e/investierte Mio. €	311,65	85,87%	296,33	81,10%	310,66	71,04%	310,66	64,71%
THG-Emissionsintensität 1 & 2 (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	39,01	85,11%	76,14	89,29%	74,78	88,21%	492,67	88,86%
Geschätzte THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO ₂ e/Mio. € Umsatz	502,55	86,85%	578,06	90,17%	749,46	88,37%	1.196,48	88,86%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,96%	86,85%	4,96%	88,42%	4,32%	84,69%	5,14%	81,11%
Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	Prozentsatz des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	57,14%	72,25%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	66,99%	3,96%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,13	7,46%	0,15	83,12%	0,18	65,27%	0,43	6,87%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,23	4,49%	3,68	83,12%	8,66	65,27%	11,63	5,14%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,12	1,21%	0,12	83,12%	0,09	65,27%	0,06	0,92%
Intensität des Energieverbrauchs:	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	4,38%	0,03	83,12%	0,03	65,27%	0,03	1,19%

		PAI im historischen Vergleich							
		2026		2025		2024		2023	
PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang	Wert	Umfang
Handel und Fahrzeuge (EUR)									
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	2,11%	0,41	83,12%	0,47	65,27%	0,11	1,86%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	83,12%	0,00	65,27%	0,00	0,00%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	86,85%	3,24%	88,43%	0,00%	84,69%	0,00%	81,11%
Emissionen in Wasser	EUR Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,00	2,38%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Gefährliche Abfälle	EUR Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,38	82,80%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	87,98%	0,00%	92,80%	0,00%	86,53%	0,00%	81,11%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,17%	86,85%	1,00%	87,87%	26,14%	84,69%	0,00%	81,11%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches geschlechtsspezifisches Lohngefälle	14,38%	75,68%	15,94%	63,56%	23,02%	29,76%	27,51%	20,65%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsrats	39,37%	85,99%	38,37%	87,62%	37,87%	84,69%	38,31%	81,11%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	87,98%	0,00%	88,42%	0,00%	84,69%	0,00%	81,11%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € BIP	201,21	10,99%	320,56	3,93%	481,28	0,02%	481,28	2,32%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	10,99%	0,00	3,93%	0,00	0,02%	0,00	2,32%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Bis 2025 wurde der Anteil der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien in einer kombinierten Kennzahl angegeben. 2026 wurde diese Kennzahl unterteilt in „Anteil des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien“ und Anteil der Erzeugung nicht-erneuerbarer Energien“.

Wir weisen darauf hin, dass methodische Änderungen die Vergleichbarkeit von KPIs in verschiedenen Berichtszeiträumen beeinflussen. 2023 und 2024 spiegelte der Engagement-KPI die Existenz einer einzigen Engagement-Liste (angegeben mit „1“) wider, während er ab 2025 die Gesamtzahl der Einzelengagements abbildet. Daher sind die Zahlen nicht direkt vergleichbar.

Wir weisen darauf hin, dass die Nachhaltigkeitsindikatoren für diesen Bezugszeitraum (Umweltchampions, Prozentsatz der Investitionen in grüne, soziale und nachhaltige Anleihen und PAIs) nun auf den Durchschnittswerten zum Ende jedes Quartals basieren. Dagegen spiegeln die Daten für 2023 in den oben stehenden Tabellen Werte zu einem bestimmten Zeitpunkt wider, d. h. am Ende des Geschäftsjahres des Fonds. Infolgedessen schränken diese methodischen Unterschiede aussagekräftige Vergleiche zwischen Zeiträumen weiter ein.

Die Anzahl der Engagements ist von 93 auf 22 zurückgegangen. Der Rückgang der Anzahl der Emittenten, mit denen im Berichtszeitraum ein Dialog geführt wurde, ist hauptsächlich auf die verstärkte Nutzung stärker in die Tiefe gehender und direkter Formate zurückzuführen, z. B. persönliche Treffen und spezielle Roadshows, die darauf abzielten, die Qualität und Wirksamkeit unserer Interaktionen zu verbessern.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Anlagen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung von:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) der sozialen Integration,
- g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- h) Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“) und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige soziale Aktivitäten zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Sozialprojekte 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.

● 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.

Die Anlageverwaltung verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen verwickelt waren. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Emissionsintensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehörten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, 18,76 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die die Anlageverwaltung als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden wie folgt verwendet:

- a. der Entfernung von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und
- b. um die Anlageverwaltung über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung siehe die Abschnitte „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie“ des Fonds in diesem Anhang).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Auf Anleihen, die von souveränen Staaten begeben wurden, waren die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben wurden, standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesen Dienstleistern festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte.

Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde er als nicht investierbar eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

- (i) Identifizierung von Emittenten, die als „Best-in-Class“ gelten,
- (ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und
- (iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die von der Anlageverwaltung als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

- Der EETI bewertet die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO₂e/BIP).

- Die ESG Credit App stuft Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung verpflichtete sich zu einem Engagement bei 5 % der aktiven Beteiligungen, die in Bezug auf ihre gesamten Risikopositionen gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Weitere Informationen darüber, wie der Fonds seine PAI berücksichtigt hat, befinden sich im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Spain Government Bond 5.15% 10/31/2028 REG S	Staatsanleihen	5,18%	Spanien
French Republic Government Bond OAT 2.4% 09/24/2028 144A REG S	Staatsanleihen	2,29%	Frankreich
Romanian Government International Bond 2.125% 03/07/2028 REG S	Staatsanleihen	2,13%	Rumänien
Cencora Inc 05/22/2028	Gesundheitssektor	2,05%	USA
Engie SA 1.75% 03/27/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	2,01%	Frankreich
National Grid PLC .163% 01/20/2028 REG S	Versorgungsunternehmen	1,94%	Vereinigtes Königreich
Caixabank SA .75% 05/26/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,86%	Spanien
ABN AMRO Bank NV 4% 01/16/2028 REG S	Finanzsektor	1,83%	Niederlande
UBS Group AG 4.625% 03/17/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,82%	Schweiz
Sage Group PLC/The 3.82% 02/15/2028 REG S	Informationstechnologie	1,82%	Vereinigtes Königreich
Credit Agricole SA .375% 04/20/2028 REG S	Finanzsektor	1,81%	Frankreich
Societe Generale SA .125% 02/18/2028 REG S	Finanzsektor	1,81%	Frankreich
Nationwide Building Society .25% 09/14/2028 REG S	Finanzsektor	1,79%	Vereinigtes Königreich
Crelan SA 5.75% 01/26/2028 REG S	Finanzsektor	1,75%	Belgien
La Banque Postale SA 1% 02/09/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,74%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

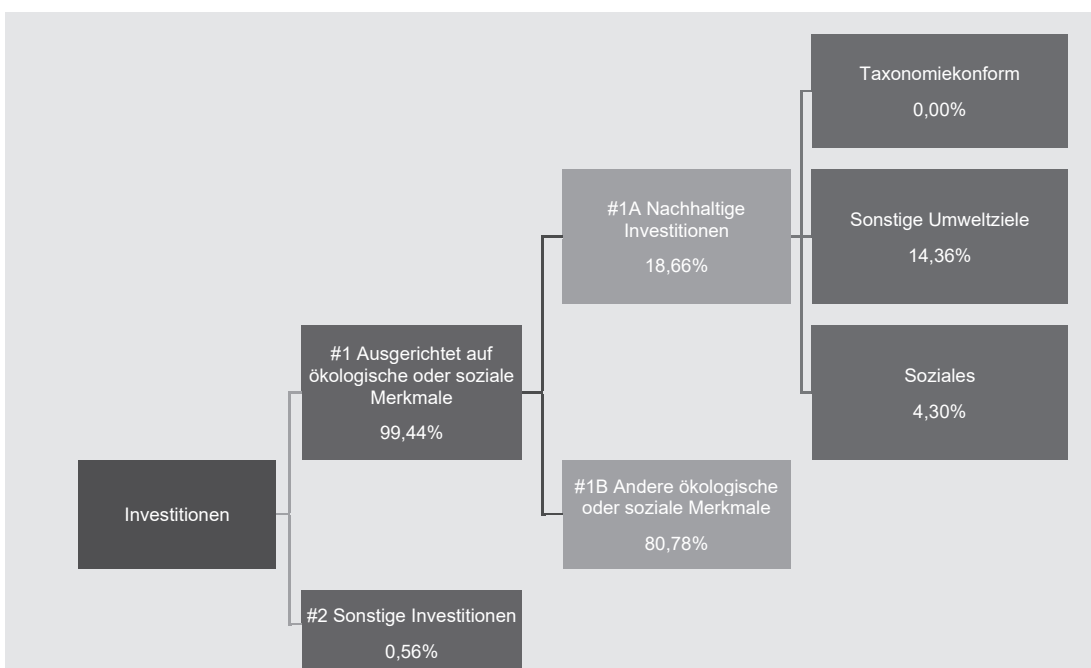
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 18,66 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

99,44 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet (sofern nicht anders angegeben, basieren alle angegebenen Werte auf dem gewichteten Durchschnitt von vier Quartalen während des Berichtsreferenzzeitraums). Der verbleibende Teil (0,56 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 18,66 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich			
	2026	2025	2024	2023
Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	99,44%	99,45%	98,56%	96,35%
#2 Sonstige Investitionen	0,56%	0,55%	1,44%	3,65%
#1A Nachhaltige Investitionen	18,66%	18,76%	15,72%	17,58%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	80,78%	80,69%	82,84%	78,77%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	14,36%	13,24%	11,24%	12,98%
Soziales	4,30%	5,52%	4,48%	4,59%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	52,77%
Industrie	12,58%
Staatsanleihen	10,98%
Gesundheitssektor	6,69%
Zyklische Konsumgüter	4,96%
Versorgungsunternehmen	4,48%
Informationstechnologie	3,29%
Grundstoffe	2,43%
Kommunikationsdienste	0,92%
Basiskonsumgüter	0,35%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	37,85%
Staatsanleihen	10,98%
Finanzdienstleistungen	7,18%
Kapitalmärkte	6,41%
Multi-Versorger	3,95%
Elektrogeräte	3,65%
Überlandtransport	2,42%
Automobilindustrie	2,26%
Luftfracht u. -logistik	2,14%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	2,05%
Behälter u. Verpackungen	2,01%
Software	1,98%
Passagierfluggesellschaften	1,61%
Allgemeiner Einzelhandel	1,58%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	1,56%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

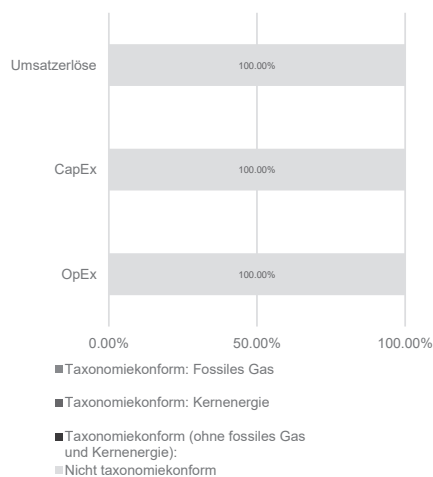
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

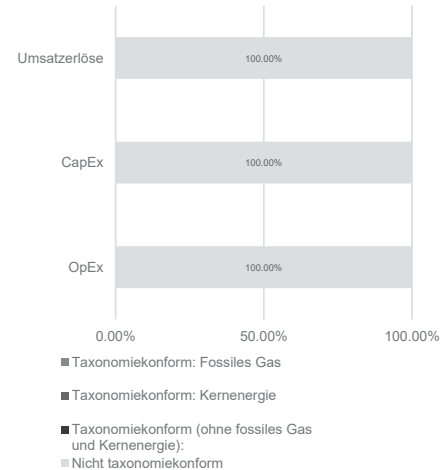
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

14,36 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 4,30 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ lag bei 0,56 % 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 Anlageverwaltung setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Diese Merkmale umfassten die Förderung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen, und die Einrichtung negativer Screenings als Teil des Anlageprozesses. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilte der Anlageverwalter, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine unternehmenseigene Methode des ESG-Rating an, um Anlagen in Emittenten zu vermeiden, die bei der Umstellung auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zurückliegen. Der Fonds wendete einen selektiven Ansatz an, um Emittenten (Unternehmen und Staaten) aus seinem Portfolio auszuschließen, die in Bezug auf verschiedene Merkmale zu den unteren 20 % seines Anlageuniversums gehörten. Bei Unternehmen prüft die Anlageverwaltung deren Treibhausgasemissionen und -intensität, während sie bei Staaten eine Liste von 16 ökologischen Indikatoren wie Energieeffizienz, Schutz der Artenvielfalt und verantwortungsvolle Abfallwirtschaft zugrunde legt. Ein innovatives IT-Tool (Energy and Environmental Transition Index [EETI]) für Staaten und die ESG Credit App für Unternehmen weist den Emittenten auf der Grundlage dieser Merkmale einen Rang zu und verkleinert das investierbare Universum um die vorgenannten 20 %.

Der Fonds führt eine eigene Ausschlussliste, und dementsprechend hat die Anlageverwaltung nicht in Emittenten investiert, die:

- wiederholt und schwerwiegend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen, die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verstoßen,
- den Status „Unfrei“ nach dem Freedom House Index (bei staatlichen Emittenten) aufweisen,
- umstrittene Waffen herstellen, z. B. solche, die als Streuwaffen bzw. unterschiedslos wirkend definiert sind, oder in Unternehmen, die Komponenten herstellen, welche für den Einsatz in derartigen Waffen vorgesehen sind,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion konventioneller Waffen erzielen
- Tabak oder Tabakwaren herstellen oder die Umsätze aus solchen Waren erzielen, die die Obergrenzen des Anlageverwalters überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an Dritte erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse mit äußerst umweltschädlichen fossilen Brennstoffen erzielen,
- die Toleranzgrenzen der Anlageverwalter für fossile Brennstoffe (30 %) oder Kraftwerkskohle (5 %) zur Stromerzeugung überschreiten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele für die Stromerzeugung verfolgen,
- sich negativ auf die biologische Vielfalt empfindlicher Gebiete auswirken und
- ein ESG-Rating von CCC nach MSCI aufweisen.

Fiele ein vom Fonds gehaltenes Wertpapier unter mindestens einen der oben genannten Ausschlüsse, würde der Anlageverwalter/die Anlageverwalterin dieses Wertpapier schnellstmöglich, spätestens jedoch nach sechs Monaten, abstoßen.

Darüber hinaus wurden die Emittenten mithilfe der Principal Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die App analysiert die Entwicklung von Unternehmen und staatlichen Emittenten auf der Grundlage der 14 verpflichtenden PAI-Kennzahlen (Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen). Die PAI-App hat im Vorfeld Emittenten identifiziert und aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen, die:

- wiederholt und gravierend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen (PAI Nr. 10),
- ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen (PAI Nr. 14),
- mit Standorten/Betrieben in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, die in Kontroversen mit schweren nachteiligen Auswirkungen auf diese Gebiete involviert sind (PAI Nr. 7)
- Länder sind, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, mindestens 11 % im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (d. h. das Bewertungsformular zu nachhaltigen Anlagen auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Aufgrund des Anspruchs der Anlageverwaltung, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüft die Anlageverwaltung zunächst, ob alle förderfähigen Vorhaben für eine Anleihe, die für den Kauf in Frage kommt, tatsächlich nachhaltig sind und einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisten. Danach stellt die Anlageverwaltung sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüft die Anlageverwaltung die Gesamtauswirkungen eines Emittenten auf die Umwelt. Genauso wichtig sind soziale Aspekte, und die Anlageverwaltung investiert nicht in grüne oder soziale Projekte, wenn nachweislich schwerwiegende Kontroversen im Zusammenhang mit den Mitarbeitern und/oder der örtlichen Kommune bestehen. Bei der Beurteilung dieser Parameter achtet die Anlageverwaltung auf 16 verpflichtende Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI).

Engagement war integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Während des Referenzzeitraums führte die Anlageverwaltung Gespräche mit zahlreichen Emittenten. Dies geschah per E-Mail, durch direkte Videoanrufe, durch die Teilnahme an Roadshows oder persönlichen Treffen sowie durch eine breit angelegte Beteiligung, indem Umfragen zu einem bestimmten Thema verschickt wurden. Dabei ging es sowohl um ein freiwilliges Engagement, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern und Daten für eine fundierte Anlageentscheidung zu erhalten, als auch um ein verpflichtendes Engagement bei 5 % der Emittenten, die in Bezug auf die PAI-Risiken schlechter abschnitten als ihre Mitbewerber.

Alle Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen.

Der Dialog fand in einem eigens vereinbarten Einzelgespräch mit der Swedbank im November 2025 statt. Bei diesem Gespräch überprüften wir die Klimastrategie der Bank und ihr anhaltendes Engagement für die Erreichung der Netto-Null-Emissionen bis 2050, trotz Auflösung der Net Zero Banking Alliance. Die Swedbank hat sich für wichtige Branchen sektorspezifische Ziele bis 2030 gesetzt und integriert diese Ziele nach und nach in ihre internen Steuerungs- und Portfolioüberwachungsrahmen. Ein besonderer Schwerpunkt wurde auf das Immobilienportfolio gelegt, auf das ein erheblicher Anteil der Anlagen der Bank entfällt. Die Swedbank gab an, dass die Datenverfügbarkeit – insbesondere zu den Energy Performance Certificates – weiterhin eine große Herausforderung darstelle, insbesondere aufgrund regulatorischer Beschränkungen, und dass Anstrengungen zur Verbesserung der Granularität und des Umfangs der Daten unternommen würden. Die Bank teilte auch mit, dass vorläufige Bewertungen darauf hindeuteten, dass nur ein kleiner Teil des Portfolios hohen physischen Klimarisiken ausgesetzt sei und dass weitere Anstrengungen unternommen würden, um die Methodik zu verfeinern und die Genauigkeit dieser Analysen zu verbessern.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den **Referenzwerten** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Nicht zutreffend.

Franklin Responsible Income 2029 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900HN2FBZVQ2RSC08



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale** beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 24,17% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen** getätigt.



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Um den Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft zu fördern hat das Team des Portfoliomanagements Engagements in so genannten „Klima-Nachzüglern“ gemieden. Als „Klima-Nachzügler“ wurden staatliche Emittenten bezeichnet, die bei Umweltfaktoren wie unter anderem Treibhausgasemissionen, Energieintensität, Schutz der Artenvielfalt, Luftverschmutzung und Mix erneuerbarer Energien zu den schlechtesten 20 % ihrer Vergleichsgruppe gehörten. Dabei handelte es sich bei Unternehmensemittenten um Unternehmen, die basierend auf der Treibhausgasintensität zu den oberen 20 % ihrer Branchenvergleichsgruppe zählten. Am Ende des Berichtszeitraums lag die Allokation des Fonds in Klima-Nachzüglern bei 0 % im Referenzzeitraum.

Zudem hat der Fonds nicht in Emittenten investiert, die in umstrittene Geschäftspraktiken oder nachteilige Wirtschaftstätigkeiten verwickelt sind (wie in den vorvertraglichen Informationen näher beschrieben). Dies gilt unter anderem für Emittenten, deren Beteiligung an der Förderung fossiler Brennstoffe oder an der Energieerzeugung aus fossilen Brennstoffen über das vom Anlageteam für akzeptabel erachtete Niveau hinausging (z. B. wird jedes Unternehmen, das mehr als 5 % seines Umsatzes aus der Förderung von Kraftwerkskohle erzielt, für nicht investierbar erachtet). Weitere Beispiele sind Emittenten, die in die Herstellung von Massenvernichtungswaffen verwickelt sind oder Unternehmen, die erheblich und wiederholt gegen den United Nations Global Compact verstoßen. Abgesehen von den aufgeführten Ausschlüssen hat der Fonds auch nicht in staatliche Emittenten investiert, die nach dem Freedom House Index als „nicht frei“ eingestuft werden.

Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines Vermögens in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen (mindestens 10 %), und zu sozialen Zielen (mindestens 1 %) beitragen.

Im Berichtszeitraum vom 3. März 2025 bis 27. Februar 2026 übertraf der Fonds diese Zusagen: In den vier Quartalen war ein gewichteter Durchschnitt von 24,17 % nachhaltig investiert. Davon waren 22,91 % Investments in Aktivitäten, die zu ökologischen Zielen beitragen und 1,26 % in Aktivitäten, die zu sozialen Zielen beitragen. Diese Allokationen erfolgten vor allem mittels Investments

in Anleihen mit vorgegebener Mittelverwendung im grünen, sozialen und/oder nachhaltigen Bereich, die ausdrücklich zur Finanzierung bestimmter zulässiger Umwelt- oder Sozialprojekte emittiert wurden.

Ein Beispiel für diese Zusagen ist das Investment des Fonds in eine Anleihe der AIB Group PLC, bei der die Verwendung der Mittel zur Unterstützung von Umweltprojekten vorgegeben war. In dem Bewusstsein, dass der weltweite Übergang zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft immense Investitionen erfordert, stellt AIB Kapital für umweltfreundliche Projekte bereit. Die Anlageleitlinien des Emittenten für grüne Anleihen konzentrieren sich auf Schlüsselbranchen wie erneuerbare Energie, sauberes Transportwesen und umweltverträgliches Bauen. Im Berichtszeitraum 2025 waren die Mittel vollständig zugeteilt. Der Gesamtbetrag der zulässigen grünen Kredite belief sich auf ca. 6,9 Mrd. EUR, die sich wie folgt verteilen: 43 % für umweltverträgliches Bauen, 55 % für erneuerbare Energie, weniger als 1 % für sauberes Transportwesen und 1 % für Kreislaufwirtschaft und Abfallmanagement.

In dieser Hinsicht hatte der gewichtete Durchschnitt über die vier Quartale im vorgenannten Berichtszeitraum zur Folge, dass 95,26 % des Fondsvermögens mit den ökologischen und sozialen Merkmalen (E/S) übereinstimmten. Die verbleibenden 4,74 % (ebenfalls auf Grundlage des gewichteten Durchschnitts) waren liquide Mittel und Derivate, die diesen Merkmalen nicht entsprachen.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

● Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Die folgenden Nachhaltigkeitsindikatoren wurden angewendet, um die Erreichung der einzelnen ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds bewirbt:

Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen Anleihen (GSS-Anleihen) und solchen, die von Umweltchampions begeben wurden.

– 20,88 % Anlagen in grünen Anleihen,

– 1,26 % Anlagen in sozialen Anleihen,

– 2,03 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen,

– 31,04 % Anlagen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden.

Der prozentuale Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, sowie zusätzliche Ausschlüsse, wie im Abschnitt über die Anlagestrategie in diesem Anhang näher beschrieben, betrug 0,00 %.

– Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren) (siehe Tabelle unten).

Die Anlageverwaltung stand zwischen dem 3. März 2025 und dem 27. Februar 2026 mit folgenden Emittenten im Austausch:

1. AIB GROUP PLC
2. AZELIS FINANCE NV
3. BANCA TRANSILVANIA
4. BANCO SANTANDER SA
5. BARRY CALLEBAUT SVCS NV
6. BNP PARIBAS
7. BPCE SA
8. CREDIT AGRICOLE SA
9. DEUTSCHE BANK AG
10. FIBERCOP SPA
11. FRANKREICH
12. ING GROEP NV
13. NATWEST GROUP PLC
14. Q-PARK HOLDING I BV
15. RAIFFEISEN BANK INTL
16. RCI BANQUE SA
17. RUMÄNIEN
18. SELP FINANCE SARL
19. SUEZ
20. SWEDBANK AB
21. TEAMSYSTEM SPA
22. VALEO SE
23. VOLVO CAR AB
24. ZEGONA FINANCE PLC

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2026	2025
	Wert	Wert
Engagement in grünen Anleihen	20,88%	26,10%

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Nachhaltigkeits-KPI im historischen Vergleich	
	2026	2025
	Wert	Wert
Engagement in sozialen Anleihen	1,26%	1,46%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	2,03%	0,00%
Engagement in Umweltchampions	31,04%	27,77%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%	0,00%
Liste der Emittenten, mit denen die Anlageverwaltung zusammenarbeitet	24,00	100,00

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich			
		2026		2025	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1	tCO2e	237,28	76,67%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 2	tCO2e	109,36	76,67%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 3 (geschätzt)	tCO2e	7.521,04	76,81%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Scope 1 & 2	tCO2e	346,64	76,67%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
THG-Emissionen: Gesamtemissionen (geschätzt)	tCO2e	7.867,67	76,81%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
CO ₂ -Fußabdruck 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	12,16	76,67%	51,42	77,93%
CO ₂ -Fußabdruck (Schätzung, EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	275,72	76,81%	373,46	78,18%
THG-Emissionsintensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	17,13	77,09%	40,16	88,34%
Geschätzte THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	435,50	77,23%	489,08	88,60%
Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	78,28%	0,22%	84,92%
Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	Prozentsatz des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	52,56%	59,53%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	0,00%	0,00%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,09	4,54%	0,07	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%	0,00	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,66	1,41%	0,79	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,15	1,14%	0,18	80,61%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	PAI im historischen Vergleich			
		2026		2025	
		Wert	Umfang	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,02	2,18%	0,04	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,08	2,16%	0,30	80,61%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,70	1,68%	0,68	80,61%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	78,70%	3,55%	84,04%
Emissionen in Wasser	EUR Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	3,92	5,44%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Gefährliche Abfälle	EUR Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	1,12	76,81%	Nicht zutreffend.	Nicht zutreffend.
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	79,78%	0,00%	88,51%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen.	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	3,29%	78,63%	0,22%	82,24%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches geschlechtsspezifisches Lohngefälle	13,46%	64,30%	15,24%	57,61%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	38,80%	77,48%	37,29%	83,75%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	79,63%	0,00%	85,05%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € BIP	202,75	12,64%	366,26	2,72%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	12,64%	0,00	2,72%

● ... und im Vergleich zu früheren Perioden?

Bis 2025 wurden die Anteile der Erzeugung und des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien in einer kombinierten Kennzahl angegeben. 2026 wurde diese Kennzahl unterteilt in „Anteil des Verbrauchs nicht-erneuerbarer Energien“ und Anteil der Erzeugung nicht-erneuerbarer Energien“. Alle anderen Kennzahlen haben sich gegenüber dem Vorjahr nicht geändert, abgesehen von der Aufteilung der Kennzahl für nicht-erneuerbare Energien.

● Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Anlagen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung von:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) der sozialen Integration,
- g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- h) Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“) und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige gesellschaftliche Aktivitäten mit einem sozialen Ziel zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Sozialprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen verwickelt waren. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Emissionsintensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehörten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, mindestens 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die die Anlageverwaltung als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden wie folgt verwendet:

a. der Entfernung von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und

b. um die Anlageverwaltung über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung siehe die Abschnitte „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie“ des Fonds in diesem Anhang).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Auf Anleihen, die von souveränen Staaten begeben wurden, waren die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben wurden, standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesem Datenanbieter festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte.

Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde er als nicht investierbar eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

(i) Identifizierung von Emittenten, die als „Best-in-Class“ gelten,

(ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und

(iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die von der Anlageverwaltung als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

· Der EETI bewertet die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO₂e/BIP).

· Die ESG Credit App stuft Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung verpflichtete sich zu einem Engagement bei 5 % der aktiven Beteiligungen, die in Bezug auf ihre gesamten Risikopositionen gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Weitere Informationen darüber, wie der Fonds seine PAI berücksichtigt hat, befinden sich in den regelmäßigen Berichten des Fonds.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-03-01 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro 3% 10/01/2029 REG S	Staatsanleihen	3,56%	Italien
Spain Government Bond 3.5% 05/31/2029	Staatsanleihen	2,80%	Spanien
Romanian Government International Bond 6.625% 09/27/2029 REG S	Staatsanleihen	2,35%	Rumänien
Italy Certificati Di Credito Del Tesoro/ CCTS-Eu FRN 04/15/2029 144A REG S	Staatsanleihen	2,05%	Italien
Standard Chartered PLC .8% 11/17/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	2,02%	Vereinigtes Königreich
Raiffeisenbank AS 1% 06/09/2028 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,82%	Tschechische Republik
Jyske Bank A/S 4.875% 11/10/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,71%	Dänemark
Societe Generale SA 4.75% 09/28/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,70%	Frankreich
Morgan Stanley 4.656% 03/02/2029 *FIXED TO FLOAT*	Finanzsektor	1,69%	USA
ING Groep NV 4.5% 05/23/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,68%	Niederlande
Credit Mutuel Arkea SA 3.5% 02/09/2029 REG S	Finanzsektor	1,64%	Frankreich
WMG Acquisition Corp 2.75% 07/15/2028 REG S	Kommunikationsdienste	1,61%	USA
UBS Group AG 7.75% 03/01/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,50%	Schweiz
Banco De Sabadell SA 5.5% 09/08/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,44%	Spanien
Commerzbank AG FRN 03/25/2029 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	1,42%	Deutschland



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

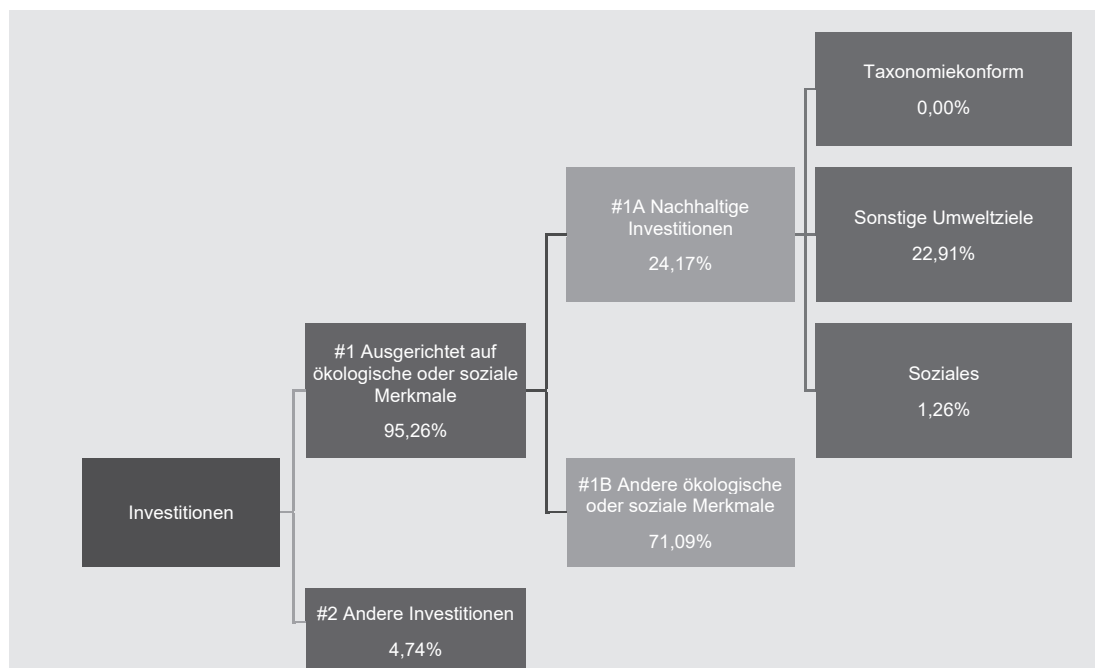
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 24,17 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,26 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet (sofern nicht anders angegeben, basieren alle angegebenen Werte auf dem gewichteten Durchschnitt von vier Quartalen während des Berichtsreferenzzeitraums). Der verbleibende Teil (4,74 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 24,17 % 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.

Anlagekategorie	Vermögensallokation im historischen Vergleich	
	2026	2025
	Anteil der Anlagen	Anteil der Anlagen
#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale	95,26%	97,66%
#2 Andere Investitionen	4,74%	2,34%
#1A Nachhaltige Investitionen	24,17%	27,56%
#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale	71,09%	70,10%
Taxonomiekonform	K. A.	K. A.
Sonstige Umweltziele	22,91%	26,10%
Soziales	1,26%	1,46%

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	47,11%
Staatsanleihen	12,64%
Industrie	11,36%
Zyklische Konsumgüter	4,97%
Kommunikationsdienste	4,81%
Basiskonsumgüter	3,78%
Immobilien	3,09%
Gesundheitssektor	2,65%
Informationstechnologie	2,59%
Versorgungsunternehmen	1,41%
Grundstoffe	0,84%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	34,22%
Staatsanleihen	12,64%
Kapitalmärkte	5,46%
Finanzdienstleistungen	5,14%
Maschinen	2,27%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	2,22%
Unterhaltung	2,17%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	2,09%
Automobilindustrie	1,97%
Elektrogeräte	1,88%
Überlandtransport	1,69%
Drahtlose Kommunikationsdienstleistungen	1,59%
Wasserversorger	1,41%
Haushaltsartikel	1,39%
Fahrzeugkomponenten	1,38%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

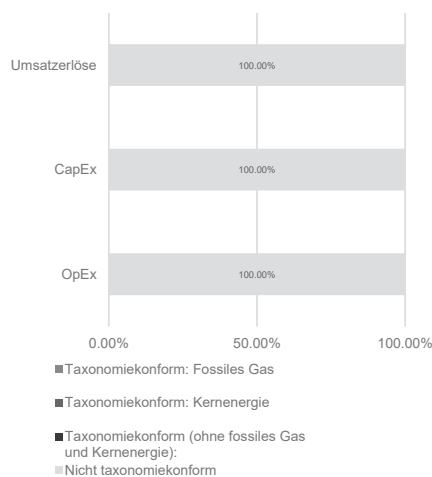
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

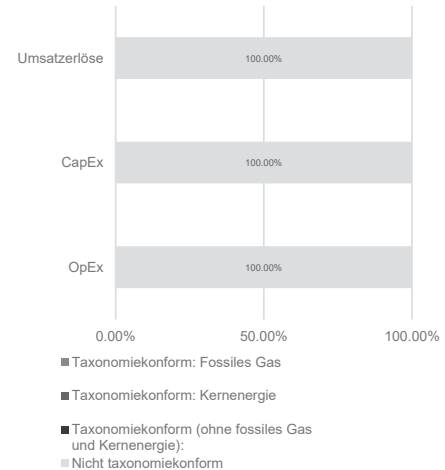
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

22,91 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 1,26 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ lag bei 4,74 % und umfasste liquide Anlagen (zusätzliche liquide Mittel, Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds), die zur Deckung des täglichen Bedarfs des Fonds gehalten wurden.

Es gab keine ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Diese Merkmale umfassten die Förderung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen, und die Einrichtung negativer Screenings als Teil des Anlageprozesses. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilte die Anlageverwaltung, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine unternehmenseigene Methode des ESG-Rating an, um Anlagen in Emittenten zu vermeiden, die bei der Umstellung auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zurückliegen. Der Fonds wendete einen selektiven Ansatz an, um Emittenten (Unternehmen und Staaten) aus seinem Portfolio auszuschließen, die in Bezug auf verschiedene Merkmale zu den unteren 20 % seines Anlageuniversums gehörten. Bei Unternehmen prüft die Anlageverwaltung deren Treibhausgasemissionen und -intensität, während sie bei Staaten eine Liste von 16 ökologischen Indikatoren wie Energieeffizienz, Schutz der Artenvielfalt und verantwortungsvolle Abfallwirtschaft zugrunde legt. Ein innovatives IT-Tool (Energy and Environmental Transition Index [EETI]) für Staaten und die ESG Credit App für Unternehmen weist den Emittenten auf der Grundlage dieser Merkmale einen Rang zu und verkleinert das investierbare Universum um die vorgenannten 20 %.

Der Fonds führt eine eigene Ausschlussliste, und dementsprechend hat die Anlageverwaltung nicht in Emittenten investiert, die:

- wiederholt und schwerwiegend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen, die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verstoßen,
- den Status „Unfrei“ nach dem Freedom House Index (bei staatlichen Emittenten) aufweisen,
- umstrittene Waffen herstellen, z. B. solche, die als Streuwaffen bzw. unterschiedslos wirkend definiert sind, oder in Unternehmen, die Komponenten herstellen, welche für den Einsatz in derartigen Waffen vorgesehen sind,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion konventioneller Waffen erzielen
- Tabak oder Tabakwaren herstellen oder die Umsätze aus solchen Waren erzielen, die die Obergrenzen des Anlageverwalters überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus dem Abbau von Kraftwerkskohle und deren Verkauf an Dritte erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse mit äußerst umweltschädlichen fossilen Brennstoffen erzielen,
- die Toleranzgrenzen der Anlageverwalter für fossile Brennstoffe (30 %) oder Kraftwerkskohle (5 %) zur Stromerzeugung überschreiten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele für die Stromerzeugung verfolgen,
- sich negativ auf die biologische Vielfalt empfindlicher Gebiete auswirken und
- ein ESG-Rating von CCC nach MSCI aufweisen.

Fiele ein vom Fonds gehaltenes Wertpapier unter mindestens einen der oben genannten Ausschlüsse, würde der Anlageverwalter/die Anlageverwalterin dieses Wertpapier schnellstmöglich, spätestens jedoch nach sechs Monaten, abstoßen.

Darüber hinaus wurden die Emittenten mithilfe der Principal Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die App analysiert die Entwicklung von Unternehmen und staatlichen Emittenten auf der Grundlage der 14 verpflichtenden PAI-Kennzahlen (Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen). Die PAI-App hat im Vorfeld Emittenten identifiziert und aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen, die:

- wiederholt und gravierend gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC) und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen verstoßen (PAI Nr. 10),
- ein Engagement in umstrittenen Waffen aufweisen (PAI Nr. 14),
- mit Standorten/Betrieben in Gebieten mit schutzbedürftiger Biodiversität, die in Kontroversen mit schweren nachteiligen Auswirkungen auf diese Gebiete involviert sind (PAI Nr. 7)
- Länder sind, die nach Maßgabe internationaler Verträge und Übereinkommen gegen soziale Bestimmungen verstoßen (PAI Nr. 16).

1. Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, mindestens 11 % des Portfolios im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (d. h. das Bewertungsformular zu nachhaltigen Anlagen auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Aufgrund des Anspruchs der Anlageverwaltung, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüft die Anlageverwaltung zunächst, ob alle förderfähigen Vorhaben für eine Anleihe, die für den Kauf in Frage kommt, tatsächlich nachhaltig sind und einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisten. Danach stellt die Anlageverwaltung sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüft die Anlageverwaltung die Gesamtauswirkungen eines Emittenten auf die Umwelt. Genauso wichtig sind soziale Aspekte, und die Anlageverwaltung investiert nicht in grüne oder soziale Projekte, wenn nachweislich schwerwiegende Kontroversen im Zusammenhang mit den Mitarbeitern und/oder der örtlichen Kommune bestehen. Bei der Beurteilung dieser Parameter achtet die Anlageverwaltung auf 16 verpflichtende Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI).

2. Engagement war integraler Bestandteil des Nachhaltigkeitsansatzes und ESG-Managements des Fonds. Während des Referenzzeitraums führte die Anlageverwaltung Gespräche mit zahlreichen Emittenten. Dies geschah per E-Mail, durch direkte Videoanrufe, durch die Teilnahme an Roadshows oder persönlichen Treffen sowie durch eine breit angelegte Beteiligung, indem Umfragen zu einem bestimmten Thema verschickt wurden. Dabei ging es sowohl um ein freiwilliges Engagement, um die ökologischen und sozialen Merkmale des Fonds zu fördern und Daten für eine fundierte Anlageentscheidung zu erhalten, als auch um ein verpflichtendes Engagement bei 5 % der Emittenten, die in Bezug auf die PAI-Risiken schlechter abschnitten als ihre Mitbewerber.

Alle Engagements sind oben im Abschnitt „Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?“ aufgeführt. Das nachfolgende Beispiel soll jedoch den Ansatz der Portfoliomanager verdeutlichen.

Der Dialog fand in einem eigens vereinbarten Einzelgespräch mit der Swedbank im November 2025 statt. Bei diesem Gespräch überprüften wir die Klimastrategie der Bank und ihr anhaltendes Engagement für die Erreichung der Netto-Null-Emissionen bis 2050, trotz Auflösung der Net Zero Banking Alliance. Die Swedbank hat sich für wichtige Branchen sektorspezifische Ziele bis 2030 gesetzt und integriert diese Ziele nach und nach in ihre internen Steuerungs- und Portfolioüberwachungsrahmen. Ein besonderer Schwerpunkt wurde auf das Immobilienportfolio gelegt, auf das ein erheblicher Anteil der Anlagen der Bank entfällt. Die Swedbank gab an, dass die Datenverfügbarkeit – insbesondere zu den Energy Performance Certificates – weiterhin eine große Herausforderung darstelle, insbesondere aufgrund regulatorischer Beschränkungen, und dass Anstrengungen zur Verbesserung der Granularität und des Umfangs der Daten unternommen würden. Die Bank teilte auch mit, dass vorläufige Bewertungen darauf hindeuteten, dass nur ein kleiner Teil des Portfolios hohen physischen Klimarisiken ausgesetzt sei und dass weitere Anstrengungen unternommen würden, um die Methodik zu verfeinern und die Genauigkeit dieser Analysen zu verbessern.



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 Franklin Responsible Income 2031 Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900RI2TI89U0AX557



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, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 22,01% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☒ mit einem sozialen Ziel
- ☐ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Da der Fonds am 17. Februar 2026 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“).

Der Fonds hat sich zu einer Mindestallokation von 11 % seines Vermögens in nachhaltigen Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten verpflichtet, die zu ökologischen Zielen (mindestens 10 %), und zu sozialen Zielen (mindestens 1 %) beitragen.

Im Berichtszeitraum vom 17. Februar 2026 bis zum 27. Februar 2026 war der Fonds auf dem besten Weg, seine Nachhaltigkeitszusagen zu erfüllen (unter Berücksichtigung dessen, dass er sich noch in der Anlaufphase befindet). In dieser Hinsicht entsprachen am Ende des oben genannten Bezugszeitraums 99,76 % des Fondsvermögens den ökologischen und sozialen Merkmalen (E/S). Die verbleibenden 0,24 % waren liquide Mittel und Derivate, die diesen Merkmalen nicht entsprachen.

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:

Mit Stand vom 17. Februar 2026 stellte sich das Engagement in grünen, sozialen und nachhaltigen Anleihen (GSS-Anleihen) und solchen, die von Umweltchampions begeben wurden, wie folgt dar:

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder

sozialen Merkmale erreicht werden.

- 22,01 % Anlagen in grünen Anleihen,
- 0,00 % Anlagen in sozialen Anleihen,
- 0,00 % Anlagen in Nachhaltigkeitsanleihen,
- 36,66 % Anlagen in Anleihen, die von Best-in-Class-Emittenten („Umweltchampions“) begeben wurden,
- Engagement im Hinblick auf Indikatoren wesentlicher negativer Auswirkungen (Principle Adverse Impact – PAI-Indikatoren) (siehe Tabelle unten).

Im Hinblick auf die Liste der Emittenten trifft dies nicht zu, da der Fonds am 17. Februar 2026 aufgelegt wurde. Darüber hinaus lagen der prozentuale Anteil der Investitionen in Emittenten, die in ausgeschlossenen Sektoren tätig sind oder mit diesen in Verbindung stehen, sowie zusätzliche Ausschlüsse, wie im Abschnitt über die Anlagestrategie in diesem Anhang näher beschrieben, bei 0 %.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Engagement in grünen Anleihen	22,01%
Engagement in sozialen Anleihen	0,00%
Engagement in Nachhaltigkeitsanleihen	0,00%
Engagement in Umweltchampions	36,66%
Engagement in ausgeschlossenen Sektoren	0,00%
Liste der Emittenten, mit denen die Anlageverwaltung zusammenarbeitet	0,00

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
THG-Emissionen: Scope 1	tCO2e	141,28	79,68%
THG-Emissionen: Scope 2	tCO2e	53,66	79,68%
THG-Emissionen: Scope 3 (geschätzt)	tCO2e	2.274,01	79,68%
THG-Emissionen: Scope 1 & 2	tCO2e	194,93	79,68%
THG-Emissionen: Gesamtemissionen (geschätzt)	tCO2e	2.468,94	79,68%
CO ₂ -Fußabdruck 1&2 (EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	49,75	79,68%
CO ₂ -Fußabdruck (Schätzung, EUR)	tCO2e/investierte Mio. €	630,08	79,68%
THG-Emissionsintensität 1 & 2 (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	68,05	81,71%
Geschätzte THG-Emissionsintensität (EUR)	tCO2e/Mio. € Umsatz	633,69	81,71%
Exponiertheit gegenüber Unternehmen mit Aktivitäten in fossilen Brennstoffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,26%	81,71%
Anteil des Verbrauchs nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil an der Gesamtenergie	69,14%	57,58%
Anteil der Erzeugung nicht erneuerbarer Energien	Prozentualer Anteil an der Gesamtenergie	48,39%	10,24%
Intensität des Energieverbrauchs: Landwirtschaft (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Bergbau (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Verarbeitendes Gewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,96	8,40%
Intensität des Energieverbrauchs: Strom (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	1,71	8,06%
Intensität des Energieverbrauchs: Wasser (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Intensität des Energieverbrauchs: Baugewerbe (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Handel und Fahrzeuge (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,00	0,00%
Intensität des Energieverbrauchs: Transport und Lagerung (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,57	8,41%
Intensität des Energieverbrauchs: Immobilien (EUR)	GWh pro Mio. € Umsatz	0,09	9,85%
Aktivitäten mit negativen Auswirkungen auf Gebiete mit empfindlicher biologischer Vielfalt	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	85,84%
Emissionen in Wasser (EUR)	Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,00	4,20%
Gefährliche Abfälle (EUR)	Metrische Tonnen / Investierte Mio. €	0,58	77,51%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	85,84%
Fehlen von Prozessen und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung von Grundsätzen des UN Global Compact und der OECD-Richtlinien für multinationale Konzerne	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	12,24%	83,76%
Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Lohngefälle	Durchschnittliches geschlechtsspezifisches Lohngefälle	11,68%	73,44%
Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen	Durchschnittlicher prozentualer Anteil weiblicher Mitglieder des Geschäftsleitungsgremiums	32,68%	77,65%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	85,84%
THG-Emissionsintensität der Länder, in die investiert wird (EUR)	tCO2e/Mio. € BIP	445,80	8,06%
Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstoßen	Anzahl der Länder im Fonds	0,00	8,06%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Nicht zutreffend. Der Fonds wurde am 17. Februar 2026 aufgelegt.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Zu den Zielsetzungen nachhaltiger Anlagen gehörten unter anderem die Finanzierung und Förderung von:

- a) der effizienten Nutzung von Energie, Rohstoffen, Wasser und Land,
- b) der Erzeugung erneuerbarer Energie,
- c) der Reduzierung von Abfall und von Treibhausgasemissionen sowie der Verringerung der Auswirkungen wirtschaftlicher Aktivitäten auf die biologische Vielfalt,
- d) der Entwicklung einer Kreislaufwirtschaft,
- e) der Bekämpfung von Ungleichheiten und der Stärkung des sozialen Zusammenhalts,
- f) der sozialen Integration,
- g) guter Beziehungen zwischen Arbeitgebern und Arbeitnehmern oder
- h) Investitionen in Humankapital, einschließlich benachteiligter Gemeinschaften.

Die nachhaltigen Investitionen des Fonds umfassten eine Mindestallokation von 10 % seines Portfolios in nachhaltige Investitionen in Wirtschaftstätigkeiten, die zu Umweltzielen beitragen.

Dies wurde durch Investitionen in als „grün“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Umweltprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Green Bond Principles der International Capital Market Association („ICMA“) und dem künftigen Green Bond Standard der Europäischen Union („EU GBS“) und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Die Verwendung der Mittel für diese Anleihen war klar definiert und auf die oben genannten Ziele ausgerichtet.

Darüber hinaus verpflichtete sich der Fonds, mindestens 1 % seines Portfolios in nachhaltige gesellschaftliche Aktivitäten mit einem sozialen Ziel zu investieren. Dies wurde durch Investitionen in als „sozial“ bezeichnete Anleihen oder in andere Wertpapiere erreicht, bei denen:

- A) Erlöse für geeignete Sozialprojekte genutzt wurden,
- B) der Rahmen mit internationalen Standards in Einklang steht (u. a. den Social Bond Principles der ICMA), und
- C) deren Emittenten andere ökologische und soziale Ziele nicht wesentlich beeinträchtigen und gleichzeitig eine gute Unternehmensführung aufweisen.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Die Anlageverwaltung verwendete eigene Dateninstrumente und qualitative Analysen, um die Ausrichtung des Portfolios an den DNSH-Grundsätzen („Do No Significant Harm“) im gesamten Portfolio sicherzustellen.

Unternehmensemittenten wurden mit Hilfe der Principle Adverse Impact Risk App („PAI Risk App“) überwacht. Die PAI Risk App nutzte Daten von MSCI, um Emittenten zu identifizieren, die in schädliche wirtschaftliche Aktivitäten und/oder Kontroversen verwickelt waren. Emittenten, von denen angenommen wird, dass sie gegen PAI Nr. 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken), Nr. 10 (Verletzung der Prinzipien des UN Global Compact und der OECD für multinationale Unternehmen) und Nr. 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) verstoßen, wurden vom Anlageuniversum des Fonds ausgeschlossen.

Die Anlageverwaltung verwendete auch den Energy and Environmental Transition Index („EETI“), der die übrigen Emittenten im Anlageuniversum des Fonds nach ihren Treibhausgasemissionen und ihrer THG-Emissionsintensität einstuft. Emittenten, die in Bezug auf PAI Nr. 1 (Treibhausgasemissionen) und Nr. 3 (CO₂-Fußabdruck) (für Unternehmen) und PAI Nr. 15 (THG-Emissionsintensität) (für Staaten) zu den untersten 20 % ihrer Vergleichsgruppen gehörten, wurden aus dem Anlageuniversum ausgeschlossen.

Darüber hinaus wurden staatliche Emittenten auf ihre politischen Freiheiten (PAI Nr. 16) und/oder Korruption überprüft.

Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, mindestens 11 % des Nettoinventarwerts (NIW) im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Indikatoren nachteiliger Auswirkungen, darunter PAI und andere Datenpunkte, die die Anlageverwaltung als Anzeichen für nachteilige Auswirkungen betrachtete, wurden wie folgt verwendet:

a. der Entfernung von Emittenten, die dem Portfolio wesentlich schaden, und

b. um die Anlageverwaltung über das mit nachteiligen Auswirkungen verbundene Risiko zu informieren und geeignete Maßnahmen zu ergreifen – dazu gehören Due-Diligence-Prüfungen, qualitative Prüfungen und/oder aktive Beteiligung (Einzelheiten zum Thema aktive Beteiligung siehe die Abschnitte „Wesentliche nachteilige Auswirkungen“ und „Anlagestrategie“ des Fonds in diesem Anhang).

Bei der Bewertung der in Frage kommenden grünen und sozialen Anleihen prüfte und dokumentierte die Anlageverwaltung die Wesentlichkeit der relevanten PAI für das Projekt sowie die Auswirkungen der Projektdurchführung auf den PAI-Gesamtausblick des Emittenten.

Wenn die Anlageverwaltung beispielsweise in eine grüne Anleihe investierte, deren Mittel für die Entwicklung erneuerbarer Energiequellen (z. B. Solar-/PV-Module) verwendet wurden, vergewisserte sie sich, dass die finanzierten Projekte in Bezug auf die PAI für Treibhausgasemissionen gut abschnitten.

Standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:

Auf Anleihen, die von souveränen Staaten begeben wurden, waren die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung (OECD) für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte nicht anwendbar. Bei Anleihen, die von Unternehmen begeben wurden, standen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang.

Diese Konformität wurde mit Hilfe von MSCI-Daten überwacht. Von diesem Datenanbieter festgestellte Verstöße wurden im Investment-Compliance-System gekennzeichnet, damit die Anlageverwaltung sie untersuchen konnte.

Ergab die Due-Diligence-Prüfung, dass der Emittent die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte nicht eingehalten hat, wurde er als nicht investierbar eingestuft.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

PAI-Indikatoren wurden zu Folgendem berücksichtigt:

(i) Identifizierung von Emittenten, die als „Best-in-Class“ gelten,

(ii) Beschränkung des Anlageuniversums des Fonds und

(iii) Hilfestellung für thematisches Engagement

Identifizierung von Best-in-Class-Emittenten

Der Fonds investierte in Anleihen von Unternehmen und Staaten, die von der Anlageverwaltung als „Umweltchampions“ eingestuft wurden. „Umweltchampions“ wurden anhand von zwei proprietären ESG-Rankings identifiziert:

· Der EETI bewertet die Leistung staatlicher Emittenten in den Bereichen Energieeffizienz, Erhaltung des Naturkapitals und erneuerbare Energien anhand verschiedener Datenpunkte, einschließlich der Treibhausgasintensität (Emissionen normiert nach Bruttoinlandsprodukt, CO₂e/BIP).

· Die ESG Credit App stuft Unternehmensemittenten nach ihren THG-Emissionen und ihrer THG-Emissionsintensität ein und verwendet dazu verschiedene Datenpunkte, wie z. B. die Scope-1- und Scope-2-THG-Emissionen sowie die historische Entwicklung der THG-Emittenten.

Einschränkung des investierbaren Universums des Fonds

Staatliche Emittenten, die basierend auf dem EETI zu den untersten 20 % des Anlageuniversums gehören, und Unternehmensemittenten, die basierend auf der ESG Credit App zu den untersten 20 % gehören (d. h. Klima-Nachzügler), wurden ebenfalls aus dem Portfolio ausgeschlossen.

Hilfestellung für thematisches Engagement

Die Anlageverwaltung verpflichtete sich zu einem Engagement bei 5 % der aktiven Beteiligungen, die in Bezug auf ihre gesamten Risikopositionen gegenüber den anwendbaren verpflichtenden PAI-Kennzahlen als Underperformer galten.

Weitere Informationen darüber, wie der Fonds seine PAI berücksichtigt hat, befinden sich in den regelmäßigen Berichten des Fonds.



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2026-02-17 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Telefonica Europe BV 6.135% 05/03/2174 PERP REG S	Kommunikationsdienste	2,19%	Niederlande
Alexandrite Monnet UK Holdco PLC 10.5% 05/15/2029 REG S	Immobilien	2,19%	Vereinigtes Königreich
Autostrade Per L'Italia Spa 4.75% 01/24/2031 REG S	Industrie	2,18%	Italien
Benteler International AG 7.25% 06/15/2031 REG S	Finanzsektor	2,17%	Österreich
Romanian Government International Bond 5.375% 03/22/2031 REG S	Staatsanleihen	2,15%	Rumänien
Unicaja Banco SA 5.5% 06/22/2034 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	2,15%	Spanien
Piraeus Bank SA 5.375% 09/18/2035 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	2,15%	Griechenland
SNF Group SACA 4.5% 03/15/2032 REG S	Basiskonsumgüter	2,11%	Frankreich
Nexans SA 4.25% 03/11/2030 REG S	Industrie	2,11%	Frankreich
Prysmian Spa 11/28/2031 REG S	Industrie	2,10%	Italien
Carnival PLC 4.125% 07/15/2031 REG S	Zyklische Konsumgüter	2,09%	USA
OTP Bank Nyrt 4.25% 10/16/2030 *FIXED TO FLOAT* REG S	Finanzsektor	2,09%	Ungarn
Getlink SE 4.125% 04/15/2030 REG S	Industrie	2,09%	Frankreich
Kapla Holding SAS 5% 04/30/2031 REG S	Industrie	2,08%	Frankreich
New Immo Holding SA 4.875% 12/08/2028 REG S	Basiskonsumgüter	2,08%	Frankreich



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

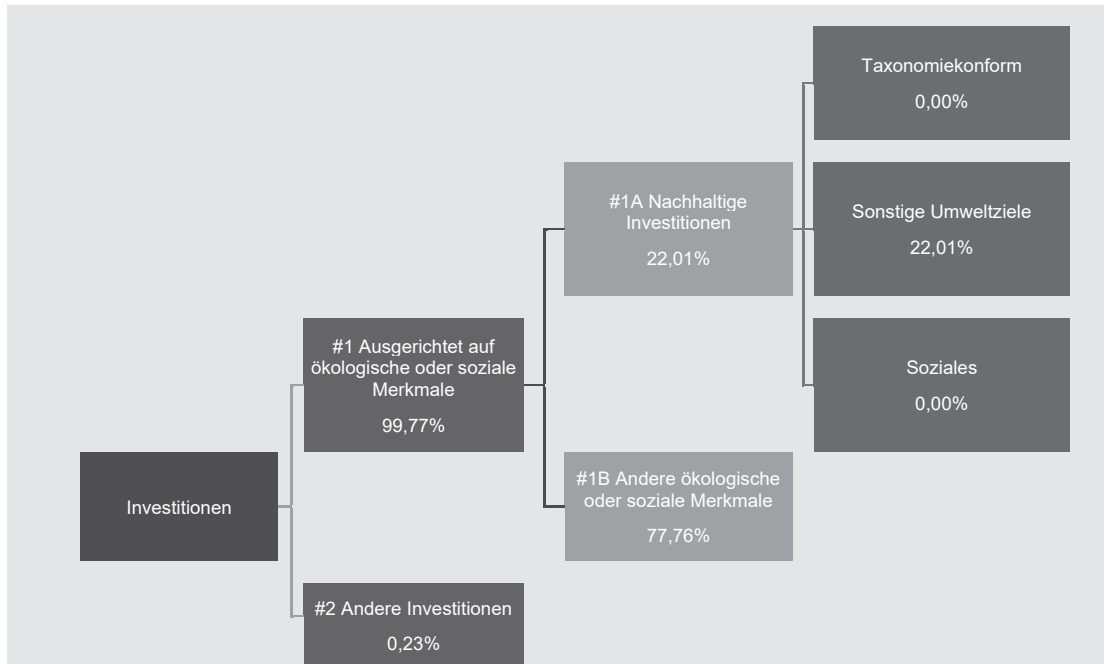
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen liegt bei 22,01 %.

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

Wie sah die Vermögensallokation aus?

Am Ende des angegebenen Bezugszeitraums waren 99,77 % des Portfolios des Fonds auf die vom Fonds beworbenen E/S-Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (0,23 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet war, investierte der Fonds 22,01 % in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Finanzsektor	26,71%
Industrie	16,76%
Versorgungsunternehmen	14,16%
Kommunikationsdienste	10,01%
Staatsanleihen	8,06%
Immobilien	7,77%
Zyklische Konsumgüter	6,14%
Basiskonsumgüter	4,19%
Gesundheitssektor	2,02%
Grundstoffe	2,01%
Informationstechnologie	1,94%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Banken	16,67%
Finanzdienstleistungen	8,19%
Stromversorger	8,18%
Staatsanleihen	8,06%
Elektrogeräte	4,21%
Gewerbliche Dienstleistungen und Versorgung	4,16%
Verkehrsinfrastruktur	4,13%
Multi-Versorger	3,94%
Medien	3,84%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	3,54%
Diversifizierte Telekommunikationsdienstleistungen	2,19%
REITs – Büro	2,19%
Luftfracht u. -logistik	2,18%
Lebensmittel	2,11%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,09%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

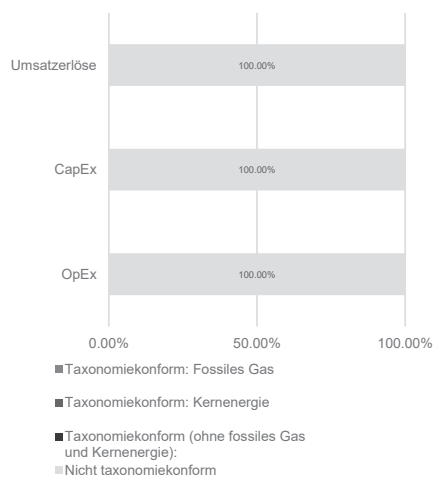
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

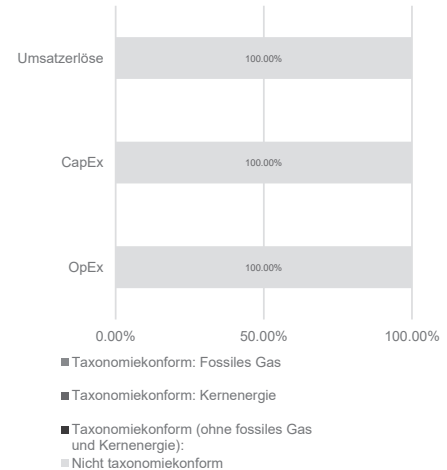
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die die Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

22,01 % des Fondsportfolios bestanden aus Anlagen mit einer ökologischen Zielsetzung, die nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichtet ist.

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ lag bei 0,23 % und umfasste liquide Anlagen (zusätzliche liquide Mittel, Bankeinlagen, Geldmarktinstrumente und Geldmarktfonds), die zur Deckung des täglichen Bedarfs des Fonds gehalten wurden.

Es gab keine ökologischen und/oder sozialen Mindestschutzmaßnahmen.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

1. Die Anlageverwaltung setzte zahlreiche IT-Tools ein, um das Portfolio so zusammenzustellen, dass es auf die beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale ausgerichtet ist. Diese Merkmale umfassten die Förderung des Übergangs zu einer kohlenstoffarmen Wirtschaft durch Vermeidung von Investitionen in Emittenten, die beim Übergang zurückliegen, und die Einrichtung negativer Screenings als Teil des Anlageprozesses. Mithilfe interner und externer Inputdaten (z. B. von MSCI) beurteilte die Anlageverwaltung, welche Emittenten für das Portfolio in Frage kamen und welche nicht.

Der Fonds wendete beispielsweise eine unternehmenseigene Methode des ESG-Rating an, um Anlagen in Emittenten zu vermeiden, die bei der Umstellung auf eine kohlenstoffarme Wirtschaft zurückliegen. Der Fonds wendete einen selektiven Ansatz an, um Emittenten (Unternehmen und Staaten) aus seinem Portfolio auszuschließen, die in Bezug auf verschiedene Merkmale zu den unteren 20 % seines Anlageuniversums gehörten. Bei Unternehmen prüft die Anlageverwaltung deren Treibhausgasemissionen und -intensität, während sie bei Staaten eine Liste von 16 ökologischen Indikatoren wie Energieeffizienz, Schutz der Artenvielfalt und verantwortungsvolle Abfallwirtschaft zugrunde legt. Ein innovatives IT-Tool (Energy and Environmental Transition Index [EETI]) für Staaten und die ESG Credit App für Unternehmen weist den Emittenten auf der Grundlage dieser Merkmale einen Rang zu und verkleinert das investierbare Universum um die vorgenannten 20 %.

Der Fonds führt eine eigene Ausschlussliste, und dementsprechend hat die Anlageverwaltung nicht in Emittenten investiert, die:

- gegen die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen, die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte und die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen verstoßen,
- den Status „Unfrei“ nach dem Freedom House Index 1 für staatliche Emittenten aufweisen (PAI Nr. 16),
- umstrittene Waffen herstellen oder vertreiben, die als Streuwaffen bzw. unterschiedslos wirkend definiert sind, oder in Unternehmen, die Komponenten herstellen, welche für den Einsatz in derartigen Waffen vorgesehen sind (PAI Nr. 14, Engagement in umstrittenen Waffen),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus der Produktion konventioneller Waffen erzielen,
- am Anbau oder an der Herstellung von Tabak beteiligt sind oder Umsätze aus solchen Waren erzielen, die die Obergrenzen der Anlageverwaltung überschreiten (5 %),
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse aus Glücksspiel oder Erwachsenenunterhaltung erzielen,
- mindestens 1 % ihrer Umsatzerlöse aus der Exploration, dem Abbau, der Förderung, dem Vertrieb oder der Raffination von Stein- und Braunkohle erzielen,
- mehr als 5 % ihrer Umsatzerlöse mit äußerst umweltschädlichen fossilen Brennstoffen erzielen,
- mindestens 50 % ihrer Umsatzerlöse aus der Exploration, der Förderung, der Produktion und/oder dem Vertrieb von gasförmigen Kraftstoffen erzielen,
- mindestens 10 % ihrer Umsatzerlöse aus der Exploration, der Förderung, dem Vertrieb oder der Raffination von erdölbasierten Kraftstoffen erzielen,
- mindestens 50 % ihrer Umsatzerlöse aus der Stromerzeugung mit einer THG-Intensität von mehr als 100 g CO₂e/kWh erzielen,
- sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken (PAI Nr. 7 – Aktivitäten, die sich nachteilig auf biodiversitätssensible Gebiete auswirken),
- die Toleranzgrenzen der Anlageverwaltung für fossile Brennstoffe (30 % Umsatz) oder Kraftwerkskohle (5 % Umsatz) zur Stromerzeugung überschreiten oder keine ehrgeizigen Dekarbonisierungsziele für die Stromerzeugung verfolgen und
- ein ESG-Rating von CCC nach MSCI aufweisen. Ausnahmen sind nur möglich, wenn der Anlageverwalter eine formale Überprüfung durchführt und einen hinreichenden Nachweis dafür erbringt, dass das ESG-Rating von CCC nicht gerechtfertigt ist.

Fiele ein vom Fonds gehaltenes Wertpapier unter mindestens einen der oben genannten Ausschlüsse, würde die Anlageverwaltung dieses Wertpapier schnellstmöglich, spätestens jedoch nach sechs Monaten, abstoßen.

1. Bei der Verwendung von Mitteln für nachhaltige Investitionen, insbesondere im Hinblick auf die Verpflichtung, mindestens 11 % des Portfolios im Einklang mit ökologischen und sozialen Zielen zu investieren, nahm die Anlageverwaltung eine zusätzliche qualitative Bewertung (d. h. das Bewertungsformular zu nachhaltigen Anlagen auf der Grundlage interner Analysen oder der Zweitmeinung externer Dritter) der DNSH-Konformität des Emittenten und der Projekte vor.

Aufgrund des Anspruchs der Anlageverwaltung, eine positive Auswirkung auf ökologische und soziale Aspekte zu erzielen und die aufsichtsrechtlichen Anforderungen zu erfüllen, prüft die Anlageverwaltung zunächst, ob alle förderfähigen Vorhaben für eine Anleihe, die für den Kauf in Frage kommt, tatsächlich nachhaltig sind und einen positiven Beitrag zu ökologischen und/oder sozialen Zielen leisten. Danach stellt die Anlageverwaltung sicher, dass weder der Emittent noch die über die Anleihe finanzierten Projekte anderen ökologischen oder sozialen Zielen erheblich schaden. Gleichzeitig prüft die Anlageverwaltung die Gesamtauswirkungen eines Emittenten auf die Umwelt. Genauso wichtig sind soziale Aspekte, und die Anlageverwaltung investiert nicht in grüne oder soziale

Projekte, wenn nachweislich schwerwiegende Kontroversen im Zusammenhang mit den Mitarbeitern und/oder der örtlichen Kommune bestehen. Bei der Beurteilung dieser Parameter achtet die Anlagerverwaltung auf 16 verpflichtende Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAI).

2. Da der Fonds am 17. Februar 2026 aufgelegt wurde, also weniger als zwei Wochen vor Ende des Berichtszeitraums, hatte die Anlageverwaltung nicht ausreichend Zeit für Engagement-Aktivitäten. Diese Aktivitäten sind für das nächste Geschäftsjahr geplant.



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 Putnam US Large Cap Growth Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
254900IM839YXZB4N283



Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine **nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ **NEIN**

- ☐ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☒ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu erörtern, die für die Emittenten wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Bei den vom Fonds geförderten ökologischen und/oder sozialen Merkmalen handelte es sich um wichtige ESG-Themen, die für das jeweilige Unternehmen und den Sektor, in dem das Unternehmen tätig ist, von wesentlicher Bedeutung sind: Klimarisiko, Treibhausgasemissionen, Einbeziehung der Mitarbeiter, Diversität, Gleichbehandlung und Inklusion, Wohlbefinden der Arbeitnehmer und Personalentwicklung, Struktur und Zusammensetzung des Leitungsorgans sowie systemisches Risikomanagement und Führung.

Derivate wurden zur Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds nicht eingesetzt. Es wurde kein Referenzwert für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale zu messen, die der Fonds im Berichtszeitraum bewarb, wurden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- Die CO₂-Intensität des Fonds war im Berichtszeitraum niedriger als die der Benchmark. Die gewichtete durchschnittliche CO₂-Intensität des Fonds (Scope 1 und 2) betrug 31,24 (tCO₂e/Mio. \$ Umsatz) und lag 11,58 % unter der der Benchmark (Scope 1 und 2), die 35,33 (tCO₂e/Mio. \$ Umsatz) betrug.

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

- Das Engagement des Fonds in Emittenten mit dem Rating „Vernachlässigbar“, „Niedrig“ oder „Mittel“ von Sustainalytics betrug im Berichtszeitraum 90,59 % und lag damit über dem Mindestziel des Fonds von 60 %.
- 100 % der Investitionen hielten die zehn Grundsätze des UN Global Compact ein.
- 100 % der Investitionen entsprachen den Ausschlussfiltern für die Geschäftstätigkeit in Bezug auf umstrittene Waffen, konventionelle Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Tabak und ähnliche Erzeugnisse und Kraftwerkskohle.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentuale Differenz zwischen der CO2-Intensität des Portfolios und der Benchmark, einschließlich Scope 1 und Scope 2 (tCO2e/Mio. \$ Umsatz)	-11,58%
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die im Hinblick auf das ESG-Risiko mit „Mittel“ oder „Vernachlässigbar“/„Niedrig“ bewertet sind	90,59%
Prozentualer Anteil der Investitionen, die mit dem UN Global Compact konform sind	100,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen, die den Ausschlussfiltern des Fonds in Bezug auf Geschäftstätigkeiten entsprechen	100,00%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Treibhausgasintensität (Scope 1 & 2)	tCO2e/Mio. € Umsatz	32,92	94,50%
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,50%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,50%

- ...

und im Vergleich zu früheren Perioden?

Nicht zutreffend.
- Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

Nicht zutreffend.
- Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?

Nicht zutreffend.
- Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Nicht zutreffend.
- 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.

Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) im Rahmen seiner Anlageentscheidungen und war bestrebt, drei PAIs durch Überwachung der Kennzahl für die CO₂-Intensität gegenüber der Benchmark und durch Anwendung der Ausschlussrichtlinien des Fonds zu minimieren. Für die Überwachung der entsprechenden Kennzahlen im Berichtszeitraum wurden externe Daten von Morningstar Sustainalytics herangezogen.

· PAI Nr. 3 (Treibhausgasintensität) – Die Anlageverwaltung bewertete die spezifischen klimabezogenen Risiken und Chancen einzelner Unternehmen im Rahmen des Aktienauswahlprozesses, der diese Aspekte neben anderen Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten mit einbezieht. Die CO₂-Intensität (einschließlich Scope 1- und Scope 2-Emissionen) des Portfolios des Fonds war im Vergleich zu seiner Benchmark niedriger. Die CO₂-Intensität ist die Menge (in Tonnen) der Gesamtemissionen, die einem Portfolio zuzurechnen sind, pro investierter Million Dollar (USD). Scope-1-Emissionen sind direkte Emissionen aus eigenen Geschäftsbetrieb eines Emittenten, während Scope-2-Emissionen indirekte Emissionen aus dem vom Emittenten bezogenen und verbrauchten Strom sind. Die CO₂-Intensität des Gesamtportfolios des Fonds wird durch den Anteil des Fonds an den Emittenten des Portfolios aufgeteilt, d. h. eigene Emissionen geteilt durch eigene Umsätze. Die Benchmark wurde nicht für die Erreichung der vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale festgelegt. Zur Überwachung der CO₂-Intensität des Fonds im Vergleich zur Benchmark zog die Anlageverwaltung einen Drittanbieter heran.

· PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien) – Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die der Bewertung zufolge den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien nicht beachten.

· PAI Nr. 14 (Verbindung zu umstrittenen Waffen) Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die einen Teil ihres Umsatzes mit der Produktion und/oder der Verteilung von umstrittenen Waffen erzielen (d. h. Tretrminen, Atomwaffen, biologische und chemische Waffen und Streumunition).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-04-04 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
NVIDIA CORP	Informationstechnologie	9,05%	USA
APPLE INC	Informationstechnologie	8,92%	USA
MICROSOFT CORP	Informationstechnologie	8,90%	USA
Broadcom Inc	Informationstechnologie	6,02%	USA
AMAZON.COM INC	Zyklische Konsumgüter	5,78%	USA
ALPHABET INC	Kommunikationsdienste	4,46%	USA
Meta Platforms Inc	Kommunikationsdienste	3,94%	USA
MASTERCARD INC	Finanzsektor	3,40%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

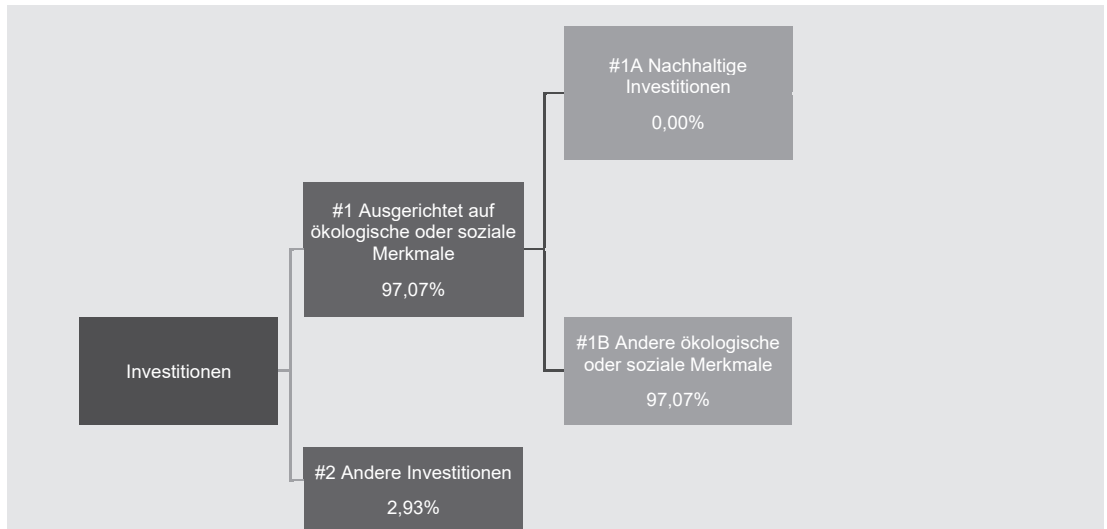
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0,00 %.

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

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

97,07 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (2,93 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 0,00 % in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Informationstechnologie	42,99%
Kommunikationsdienste	11,89%
Zyklische Konsumgüter	11,79%
Finanzsektor	10,76%
Gesundheitssektor	8,27%
Industrie	6,16%
Immobilien	2,53%
Grundstoffe	1,65%
Basiskonsumgüter	0,61%
Versorgungsunternehmen	0,42%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Halbleiter u. Halbleiterausrüstung	17,05%
Software	15,52%
Technologie – Hardware, Speicherung u. Peripheriegeräte	8,92%
Finanzdienstleistungen	8,55%
Interaktive Medien u. Dienstleistungen	8,40%
Allgemeiner Einzelhandel	5,78%
Pharmaindustrie	3,81%
Unterhaltung	3,49%
Automobilindustrie	3,32%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	2,75%
Hotels, Restaurants u. Freizeit	2,69%
Immobilienverwaltung u. -entwicklung	1,57%
Kapitalmärkte	1,32%
Baustoffe	1,29%
Elektrogeräte	1,23%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

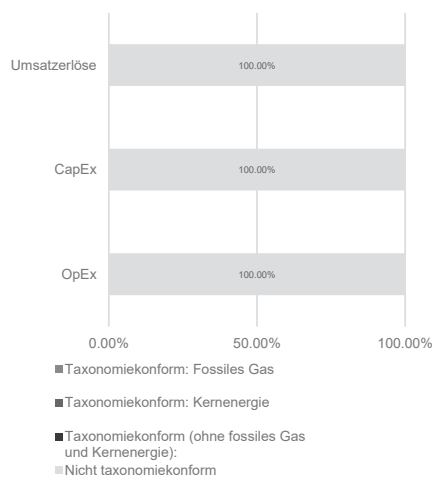
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

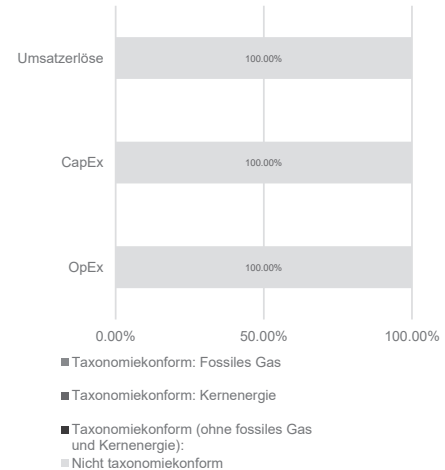
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 0,00 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der Anlagen unter „#2 Andere Investitionen“ betrug 2,93 %. Die Kategorie „#2 Andere Investitionen“ umfasst als Einlagen gehaltene liquide Mittel, Barmitteläquivalente und derivative Instrumente (die zu Anlagezwecken, für ein effizientes Portfoliomanagement und/oder zur Absicherung eingesetzt werden) und Derivate (zur Absicherung), für die es keinen ökologischen oder sozialen Mindestschutz gibt.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog mit dem oberen Management und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu steuern, die für die Emittenten wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Die folgenden Maßnahmen wurden ergriffen:

- Förderung eines wirksamen Managements des Klimarisikos und der Energieeffizienz durch Investitionen in Emittenten mit geringerer CO2-Intensität,
- Förderung eines besseren oder verbesserten Unternehmensverhaltens, einschließlich positiver Arbeitsbeziehungen und/oder einer langfristigen Geschäftsstrategie, indem mindestens 60 % des Portfolios in Emittenten mit einem ESG-Rating von „Mittel“, „Niedrig“ oder „Vernachlässigbar“ investiert werden,
- Förderung der Einhaltung der internationalen Normen durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen,
- Förderung des sozialen Wohlergehens durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die an der Herstellung und/oder am Vertrieb konventioneller Waffen, an der Herstellung und/oder am Vertrieb umstrittener Waffen, wie in der Franklin Templeton EU Funds Policy beschrieben, und an der Herstellung und/oder am Vertrieb von Erwachsenenunterhaltung beteiligt sind,
- Förderung der öffentlichen Gesundheit durch Ausschluss von Geschäftstätigkeiten in Verbindung mit Tabak,
- Förderung umweltfreundlicher Unternehmenspraktiken durch Ausschluss von Geschäftstätigkeiten in Verbindung mit Kraftwerkskohle

Im Berichtszeitraum fand ein regelmäßiger Austausch mit den Portfoliounternehmen über ESG-Themen statt, um die Pläne der Emittenten zur Steuerung wesentlicher ESG-Risiken und die Fortschritte gemessen an diesen Plänen zu bewerten. Die Ansichten des Investment-Teams zum ESG-Risikomanagement der Emittenten, wie bei diesen Besprechungen erörtert, spiegeln sich in der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider. Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu unternehmerischer Verantwortung: <https://www.franklintempleton.com/forms-literature/download/ESPOL-B> Im Berichtszeitraum nahm der Fonds an 304 Abstimmungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung zur Förderung einer guten Unternehmensführung und zur Verbesserung der Nachhaltigkeitspraktiken teil.



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 Putnam Global Healthcare Fund (der „Fonds“)

Unternehmenskennung (LEI-Code):
2549001Y3T456VVZCV42



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, 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 Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten** enthält. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

☐ ☐ **JA**

- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **Umweltziel** getätigt: 0,00%
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ Es wurden damit **nachhaltige Investitionen** mit einem **sozialen Ziel** getätigt: 0,00%

☒ ☒ **NEIN**

- ☐ Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale** beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 0,00% an nachhaltigen Investitionen
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind
- ☐ mit einem sozialen Ziel
- ☒ Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, **aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt.**



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog mit dem oberen Management und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu erörtern und anzugehen, die wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Der Fonds bewarb die folgenden ökologischen und/oder sozialen Merkmale:

- a) Einhaltung der internationalen Normen durch Ausschluss von Investitionen, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen,
- b) besseres oder verbessertes Unternehmensverhalten, einschließlich positiver Arbeitsbeziehungen und/oder einer langfristigen Geschäftsstrategie durch Investitionen in Emittenten mit den unten beschriebenen ESG-Risiko-Ratings,
- c) i) soziales Wohlergehen, das durch den Ausschluss der Produktion und/oder des Vertriebs von konventionellen Waffen, der Produktion und/oder des Vertriebs umstrittener Waffen, wie in der Franklin Templeton EU Funds Policy beschrieben, und der Produktion und/oder des Vertriebs von Erwachsenenunterhaltung erreicht wird, ii) öffentliche Gesundheit, die durch den Ausschluss von Tabakwaren erreicht wird, iii) umweltfreundliche Unternehmenspraktiken, die durch den Ausschluss von Kraftwerkskohle erreicht werden.

Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Mit **Nachhaltigkeitsindikatoren** wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

Um die Erreichung der ökologischen oder sozialen Merkmale des Fonds zu messen, werden folgende Nachhaltigkeitsindikatoren herangezogen:

- 100 % der Investitionen hielten die zehn Grundsätze des UN Global Compact ein.
- 100 % der Investitionen entsprachen den Ausschlussfiltern für die Geschäftstätigkeit in Bezug auf umstrittene Waffen, konventionelle Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Tabak und ähnliche Erzeugnisse und Kraftwerkskohle.

Name des Nachhaltigkeits-KPI	Wert
Prozentualer Anteil der Investitionen in Emittenten, die im Hinblick auf das ESG-Risiko mit „Mittel“ oder „Vernachlässigbar“/„Niedrig“ bewertet sind	90,22%
Prozentualer Anteil der Investitionen, die mit dem UN Global Compact konform sind	100,00%
Prozentualer Anteil der Investitionen, die den Ausschlussfiltern des Fonds in Bezug auf Geschäftstätigkeiten entsprechen	100,00%

PAI-Indikatoren	Maßeinheit	Wert	Umfang
Verstöße gegen die UNGC-Prinzipien und OECD-Leitsätze	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,53%
Engagement in umstrittenen Waffen	Investierter prozentualer Anteil des Fondsvermögens	0,00%	94,78%

● **... und im Vergleich zu früheren Perioden?**

Nicht zutreffend.

● **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trug die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Nicht zutreffend.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Nicht zutreffend.

----- **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Nicht zutreffend.

----- **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.

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, welche die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten. Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.



Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Der Fonds berücksichtigte die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (PAIs) im Rahmen seiner Anlageentscheidungen und war bestrebt, zwei PAIs durch Anwendung der Ausschlussrichtlinien des Fonds zu minimieren. Für die Überwachung der entsprechenden Kennzahlen im Berichtszeitraum wurden externe Daten von Morningstar Sustainalytics herangezogen.

- PAI Nr. 10 (Verstöße gegen den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien) – Der Fonds investierte nicht in Unternehmen, die der Bewertung zufolge den UN Global Compact und die OECD-Leitlinien nicht beachten.
- PAI Nr. 14 (Verbindung zu 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).



Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Im Referenzzeitraum setzten sich die Hauptinvestitionen dieses Fonds (ohne liquide Mittel) wie folgt zusammen:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil** der im Bezugszeitraum getätigten **Investitionen** des Finanzprodukts entfiel: 2025-05-30 - 2026-02-28.

Größte Investitionen	Sektor	% der Vermögenswerte	Land
Eli Lilly & Co	Gesundheitssektor	9,55%	USA
JOHNSON & JOHNSON	Gesundheitssektor	6,63%	USA
Abbvie Inc	Gesundheitssektor	6,59%	USA
UNITEDHEALTH GROUP INC	Gesundheitssektor	5,47%	USA
ASTRAZENECA PLC	Gesundheitssektor	5,26%	Vereinigtes Königreich
NOVARTIS AG	Gesundheitssektor	4,51%	Schweiz
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Gesundheitssektor	4,47%	USA
INTUITIVE SURGICAL INC	Gesundheitssektor	3,86%	USA
BOSTON SCIENTIFIC CORP	Gesundheitssektor	3,80%	USA



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

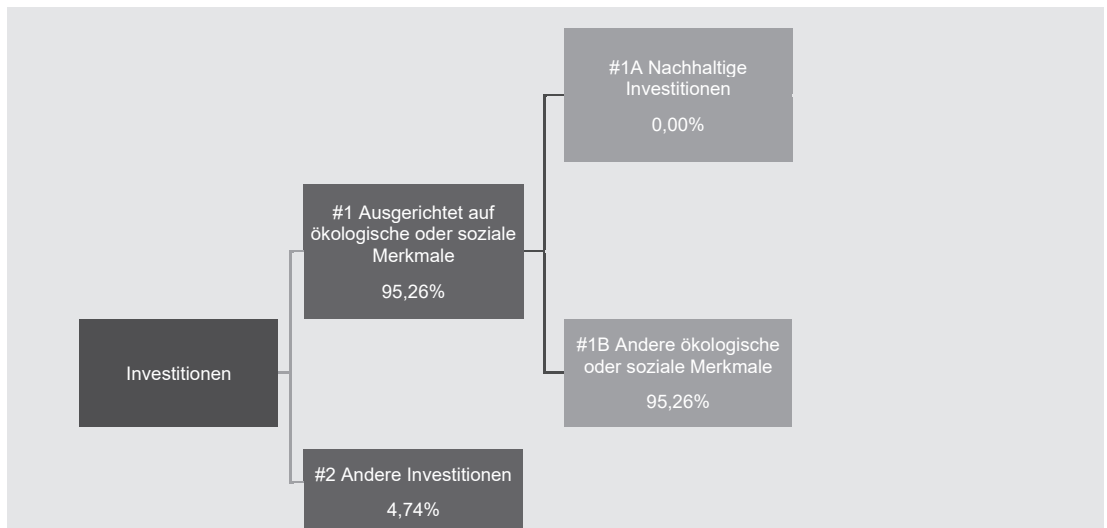
Der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen lag bei 0,00 %.

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

● Wie sah die Vermögensallokation aus?

95,26 % des Fondsportfolios waren auf die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale ausgerichtet. Der verbleibende Teil (4,74 %) des Portfolios war nicht auf die beworbenen Merkmale ausgerichtet und bestand hauptsächlich aus liquiden Mitteln.

Von dem Portfoliosegment, das an den beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen ausgerichtet ist, investierte der Fonds 0,00 % in nachhaltige Anlagen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Die Kategorie **#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie **#1A Nachhaltige Investitionen** umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie **#1B Andere ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

● **In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?**

Die Hauptsektoren und Untersektoren dieses Fonds (ohne liquide Mittel) setzten sich im Referenzzeitraum wie folgt zusammen:

Wichtigster Sektor	% der Vermögenswerte
Gesundheitssektor	95,26%
Wichtigster Teilsektor	% der Vermögenswerte
Pharmaindustrie	40,04%
Biotechnologie	19,34%
Gesundheitsdienstleister u. -dienstleistungen	15,20%
Gesundheitssektor – Geräte u. Materialien	14,99%
Biowissenschaft – Hilfsmittel u. Dienstleistungen	5,68%

Mit Blick auf die EU-Taxonomiekonformität umfassen die Kriterien für **fossiles Gas** die Begrenzung der Emissionen und die Umstellung auf voll erneuerbare Energie oder CO₂-arme Kraftstoffe bis Ende 2035. Die Kriterien für **Kernenergie** beinhalten umfassende Sicherheits- und Abfallentsorgungsvorschriften.

Ermöglichende Tätigkeiten wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

Übergangstätigkeiten sind Tätigkeiten, für die es noch keine CO₂-armen Alternativen gibt und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die die gegenwärtige „Umweltfreundlichkeit“ der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen, für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevanten Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen

- **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?

Nicht zutreffend.

Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?¹

☐ Ja

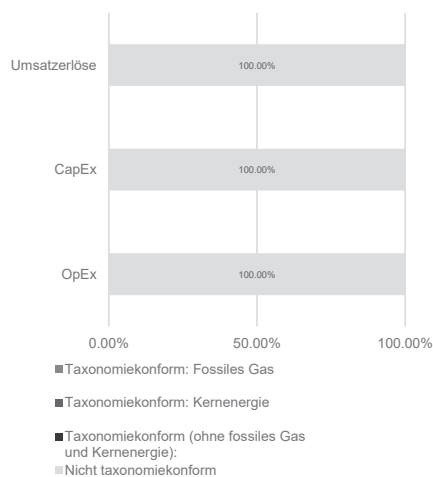
☐ In fossiles Gas

☐ In Kernenergie

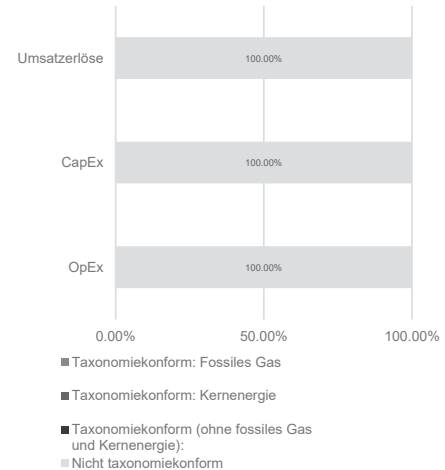
☒ Nein

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der 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. Taxonomie-Konformität 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.

Wie hoch war der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?

Der Fonds investierte nicht in Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten.

Wie hat sich der Anteil der mit der EU-Taxonomie konformen Investitionen im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?

Nicht zutreffend.

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäß der Verordnung (EU) 2020/852 **nicht berücksichtigen**.



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

Als Ergebnis der Fondsanlagestrategie tätigte der Fonds keine nachhaltigen Anlagen mit einer auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung. Dementsprechend bestand das Fondsportfolio zu 0,00 % aus Anlagen mit einer nicht auf die EU-Taxonomie ausgerichteten ökologischen Zielsetzung.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Der Anteil sozial nachhaltiger Investitionen betrug 0,00 %.



Welche Investitionen fielen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt, und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

Der Anteil der unter „#2 Andere Investitionen“ fallenden Anlagen betrug 4,74 % und umfasste Zahlungsmittel, Zahlungsmitteläquivalente und Derivate.



Welche Maßnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Die Anlageverwaltung integrierte im Berichtszeitraum ESG-Analysen in das Fundamentalresearch und den Portfolioaufbau und nutzte den aktiven Dialog mit dem oberen Management und die Stimmrechtsvertretung, um ESG-Risiken zu steuern, die für die Emittenten wesentlich und finanziell relevant sind, und eine Verbesserung der Transparenz für die Anleger zu empfehlen.

Die folgenden Maßnahmen wurden ergriffen:

- Förderung eines besseren oder verbesserten Unternehmensverhaltens, einschließlich positiver Arbeitsbeziehungen und/oder einer langfristigen Geschäftsstrategie, indem mindestens 60 % des Portfolios in Emittenten mit einem ESG-Rating von „Mittel“, „Niedrig“ oder „Vernachlässigbar“ investiert werden,
- Förderung der Einhaltung der internationalen Normen durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die gegen den Global Compact der Vereinten Nationen verstoßen,
- Förderung des sozialen Wohlergehens durch Beschränkung von Investitionen in Emittenten, die an der Herstellung und/oder am Vertrieb konventioneller Waffen, an der Herstellung und/oder am Vertrieb umstrittener Waffen, wie in der Franklin Templeton EU Funds Policy beschrieben, und an der Herstellung und/oder am Vertrieb von Erwachsenenunterhaltung beteiligt sind,
- Förderung der öffentlichen Gesundheit durch Ausschluss von Geschäftstätigkeiten in Verbindung mit Tabak,
- Förderung umweltfreundlicher Unternehmenspraktiken durch Ausschluss von Geschäftstätigkeiten in Verbindung mit Kraftwerkskohle

Im Berichtszeitraum fand ein regelmäßiger Austausch mit den Portfoliounternehmen über ESG-Themen statt, um die Pläne der Emittenten zur Steuerung wesentlicher ESG-Risiken und die Fortschritte gemessen an diesen Plänen zu bewerten. Die Ansichten des Investment-Teams zum ESG-Risikomanagement der Emittenten, wie bei diesen Besprechungen erörtert, spiegeln sich in der Stimmrechtsvertretung und den Anlageentscheidungen wider. Um mehr über unseren Engagement-Ansatz zu erfahren, lesen Sie bitte unsere Grundsätze zu unternehmerischer Verantwortung: 2025 Whitepaper-EngagementandStewardshipPolicy-en-US.indd. Im Berichtszeitraum nahm der Fonds an 51 Abstimmungen im Rahmen der Stimmrechtsvertretung zur Förderung einer guten Unternehmensführung und zur Verbesserung der Nachhaltigkeitspraktiken teil.



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.